

【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年10月9日提出
【発行者名】	野村アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	C E O兼代表取締役社長 中川 順子
【本店の所在の場所】	東京都江東区豊洲二丁目2番1号
【事務連絡者氏名】	松井 秀仁
【電話番号】	03-6387-5000
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	野村外国債券（含む新興国）インデックス Bコース（野村投資一任口座向 け）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	2兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、有価証券報告書を提出いたしましたので、2020年4月10日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を更新するため、また、記載事項の一部に変更がありますので本訂正届出書を提出するものです。

2【訂正の内容】

原届出書の下記の記載事項につきましては内容を更新・訂正いたします。

第二部ファンド情報 第1ファンドの状況 5運用状況

第二部ファンド情報 第3ファンドの経理状況

また、それ以外の訂正事項につきましては、＜訂正前＞および＜訂正後＞に記載している下線部__は訂正部分を示し、＜更新後＞の記載事項は原届出書の更新後の内容を示します。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1 ファンドの性格

(3) ファンドの仕組み

< 更新後 >

委託会社の概況(2020年8月末現在)

・名称

野村アセットマネジメント株式会社

・資本金の額

17,180百万円

・会社の沿革

1959年12月1日

野村證券投資信託委託株式会社として設立

1997年10月1日

投資顧問会社である野村投資顧問株式会社と合併して野村アセット・マネジメント投信株式会社に商号を変更

2000年11月1日

野村アセットマネジメント株式会社に商号を変更

・大株主の状況

名称	住所	所有株式数	比率
野村ホールディングス株式会社	東京都中央区日本橋1-13-1	5,150,693株	100%

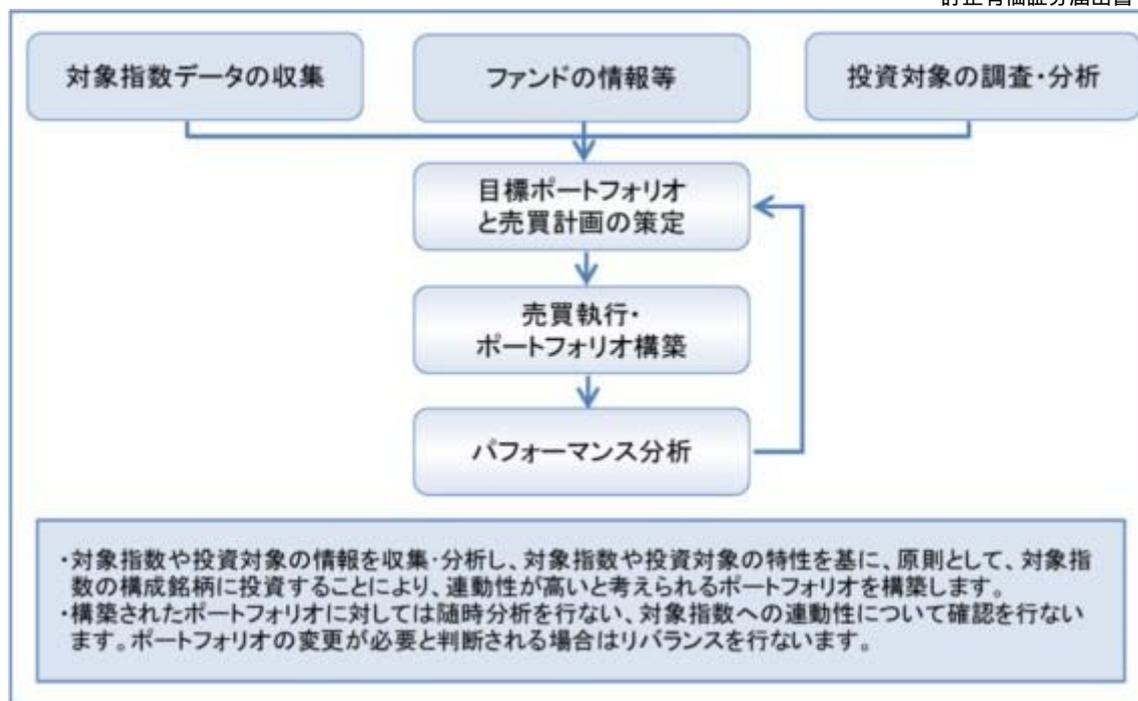
2 投資方針

(1) 投資方針

< 更新後 >

外国債券マザーファンド受益証券および新興国債券マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、対象指数の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。

投資プロセス



* 上記の投資プロセスは、今後変更となる場合があります。

各マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として外国（新興国を含みます。）の債券に投資します。

各マザーファンド受益証券への投資配分比率は、対象指数における先進国（除く日本）および新興国の割合をもとに決定します。投資配分比率は、適宜見直しを行いません。

2020年10月 9日現在の投資割合

投資対象地域	マザーファンド名	主要投資対象	対象指数	投資割合
先進国 (除く日本)	外国債券マザーファンド	外国の公社債	FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）	83.7%
新興国	新興国債券マザーファンド	新興国の公社債	JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）	16.3%

各マザーファンド受益証券の組入比率の合計は、原則として高位を維持することを基本とします。

対象指数の動きに効率的に連動する投資成果を目指すため、債券先物取引等のデリバティブ取引および為替予約取引を実質的に投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的または為替相場等の変動リスクを減じる目的で、ヘッジ目的外の利用も含め実質的に活用する場合があります。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

指数の著作権等について

・ FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

・ 本書に含まれるJPモルガンのインデックス商品（インデックスのレベルも含まれますが、これに限られません。）（以下、「本インデックス」といいます。）に関する情報（以下、「当情報」といいます。）は、情報の提供のみを目的として作成したものであり、金融商品の募集・勧誘若しくはその一部を構成し、又は本インデックスが参照する取引又は商品の価値若しくは価格を公式に確認するものではありません。当情報は、いかなる投資戦略の採用を推奨するものでもなく、法令、税務又は会計上の助言を行うものではありません。当情報に含まれる市場価格、データその他の情報は、信頼できると思われるものですが、その完全性及び正確性を保証するものではありません。当情報の内容については、今後予告なく変更されることがあります。当情報に含まれる実績は過去のものであって将来の運用成果を示すものではなく、将来の運用成績は変化します。JPモルガン、その関係会社又はそれらの従業員は、本インデックスの発行体のデータに係る金融商品について自己のポジション（ロング若しくはショート）を有し、取引を行い、又はそのマーケット・メイカーとして行為している可能性があるほか、かかる発行体の引受人、販売代理人、アドバイザー又は貸主となっている可能性があります。

ジェー・ピー・モルガン・セキュリティーズ・エルエルシー（以下、「JPMSL」又は「インデックス・スポンサー」といいます。）は、本インデックスにおいて参照する証券、金融関連商品又は取引（以下「該当商品」といいます。）を、賛助し、支持し、又はその他の方法で勧誘するものではありません。インデックス・スポンサーは、証券や金融関連商品一般に投資すること若しくは個別の該当商品に投資することの有用性について、又は金融市場における投資機会を追跡記録し、若しくは目的を達成するための本インデックスの有用性について、明示黙示を問わず、何らの表明又は保証をするものではありません。インデックス・スポンサーは、該当商品の管理、マーケティング又は取引に関連して、何らの責任又は義務を負いません。本インデックスは、信頼できると思われる情報に基づいて作成されたものですが、インデックス・スポンサーは、その完全性及び正確性並びに本インデックスに関連して提供されるその他の情報に責任を負うものではありません。本インデックスは、インデックス・スポンサーに帰属し、インデックス・スポンサーが一切の財産権を保持します。

JPMSLは、全米証券業者協会、ニューヨーク証券取引所及び米国証券投資家保護公社の会員です。「JPモルガン」は、ジェー・ピー・モルガン・チェース・バンク・エヌ・エー、JPMSL、ジェー・ピー・モルガン・セキュリティーズ・リミテッド（英国金融監督庁認可、ロンドン証券取引所会員）及びその投資銀行業務関連会社の投資銀行業務についてのマーケティング上の名称です。

当情報に関して追加で必要な情報がありましたらお問い合わせください。当情報に関するご連絡は、index.research@jpmorgan.com宛にお願いします。当情報に関する追加の情報については、www.morganmarkets.comもご覧ください。

当情報の著作権は、ジェー・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニーに帰属します。

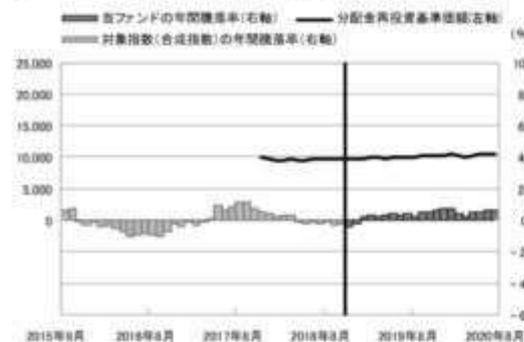
3 投資リスク

< 更新後 >

リスクの定量的比較

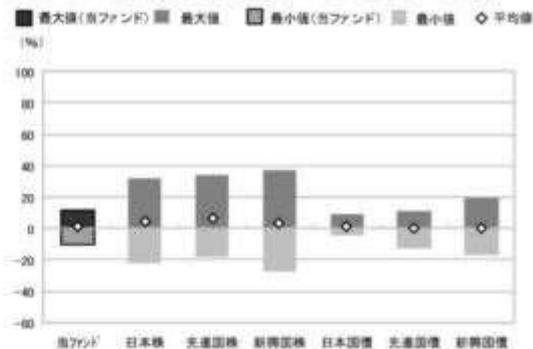
(2015年9月末～2020年8月末:月次)

〈ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移〉



- 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定前日目を 10,000 として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- 年間騰落率は、2015年9月から2020年8月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。なお、2018年11月までは、対象指数(合成指数)の騰落率を表示しております。

〈ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較〉



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値(%)	11.3	32.2	34.1	37.2	9.3	11.4	19.3
最小値(%)	△10.1	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値(%)	1.1	4.2	6.6	3.2	1.6	0.7	0.3

- 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- 2015年9月から2020年8月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。なお、当ファンドの設定日以前の年間騰落率につきましては、当ファンドの対象指数(合成指数)を用いて算出しております。
- 決算日に対応した数値とは異なります。
- 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算しており、実際の基準価額と異なる場合があります。

＜代表的な資産クラスの指数＞

- 日本株:東証株価指数(TOPIX)(配当込み)
- 先進国株:MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円ベース)
- 新興国株:MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
- 日本国債:NOMURA-BPI国債
- 先進国債:FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)
- 新興国債:JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースィファイド(円ベース)

■代表的な資産クラスの指数の著作権等について■

- 東証株価指数(TOPIX)(配当込み)・・・東証株価指数(TOPIX)(配当込み)は、株式会社東京証券取引所(東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
- MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円ベース)、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)・・・MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円ベース)、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)は、MSCIが開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCIに帰属します。またMSCIは、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- NOMURA-BPI国債・・・NOMURA-BPI国債の知的財産権は、野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、NOMURA-BPI国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI国債を用いて行われる野村アセットマネジメント株式会社の事業活動、サービスに関し一切責任を負いません。
- FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)・・・FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
- JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースィファイド(円ベース)・・・「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースィファイド(円ベース)」(ここでは「指数」とよびます)についてはここに提供された情報は、指数のレベルも含め、厳しめに限定することなく、情報としてのみ使用されるものであり、金融商品の売買を勧誘、何らかの売買の公式なコンファIRMーション、或いは指数に関連する何らかの商品の価値や価値を決めるものでもありません。また、投資戦略や税金における会計アドバイスは法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JP Morgan Chase & Co. 及びその子会社(以下、JPM)がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを示唆するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPMやその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持ったり、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または貸主になっている可能性もあります。米国のJP Morgan Securities LLC(ここでは「JPMSLLC」と呼びます)(「指数スポンサー」)は、指数に関する証券、金融商品または取引(ここでは「プロダクト」と呼びます)についての奨励、保障または販売促進を行いません。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に連動させる或いはそれを目的とする推奨の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または示唆を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は信用できると考えられる情報によって算出されていますが、その完全性や正確性、また指数に付随する情報について保証するものではありません。指数は指数スポンサーが保有する財産であり、その財産権はすべて指数スポンサーに帰属します。JPMSLLCはNASDAQ, NYSE, SIPCの会員です。JP MorganはJP Morgan Chase Bank, N.A. JPMS, JP Morgan Securities PLC.、またはその関係会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。

(出所:株式会社野村総合研究所、FTSE Fixed Income LLC 他)

4 手数料等及び税金

(5) 課税上の取扱い

< 更新後 >

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

個人、法人別の課税について

個人の投資家に対する課税

< 収益分配金に対する課税 >

分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、20.315%(国税(所得税及び復興特別所得税)15.315%および地方税5%)の税率による源泉徴収が行なわれます。なお、確定申告により、申告分離課税もしくは総合課税のいずれかを選択することもできます。

なお、配当控除は適用されません。

< 換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対する課税 >

換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）については、申告分離課税により20.315%(国税15.315%および地方税5%)の税率が適用され、源泉徴収口座を選択した場合は20.315%の税率により源泉徴収が行なわれます。

損益通算について

以下の所得間で損益通算が可能です。上場株式等の配当所得については申告分離課税を選択したものに限りです。

《利子所得》	《上場株式等に係る譲渡所得等》 ^(注2)	《配当所得》
<ul style="list-style-type: none"> ・ 特定公社債^(注1)の利子 ・ 公募公社債投資信託の収益分配金 	特定公社債、公募公社債投資信託、上場株式、公募株式投資信託の <ul style="list-style-type: none"> ・ 譲渡益 ・ 譲渡損 	<ul style="list-style-type: none"> ・ 上場株式の配当 ・ 公募株式投資信託の収益分配金

(注1)「特定公社債」とは、国債、地方債、外国国債、公募公社債、上場公社債、2015年12月31日以前に発行された公社債（同族会社が発行した社債を除きます。）などの一定の公社債をいいます。

(注2)株式等に係る譲渡所得等について、上場株式等に係る譲渡所得等とそれ以外の株式等に係る譲渡所得等に区分し、別々の分離課税制度とすることとされ、原則として、これら相互の通算等ができないこととされました。

法人の投資家に対する課税

分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに換金（解約）時および償還時の個別元本超過額については、15.315%(国税15.315%)の税率で源泉徴収が行なわれます。なお、地方税の源泉徴収はありません。

源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

換金（解約）時および償還時の課税について

[個人の投資家の場合]

換金（解約）時および償還時の差益 については、譲渡所得とみなして課税が行われます。

換金（解約）時および償還時の価額から取得費（申込手数料（税込）を含む）を控除した利益を譲渡益として課税対象となります。

[法人の投資家の場合]

換金（解約）時および償還時の個別元本超過額が源泉徴収の対象（配当所得）となります。

なお、買取りによるご換金について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

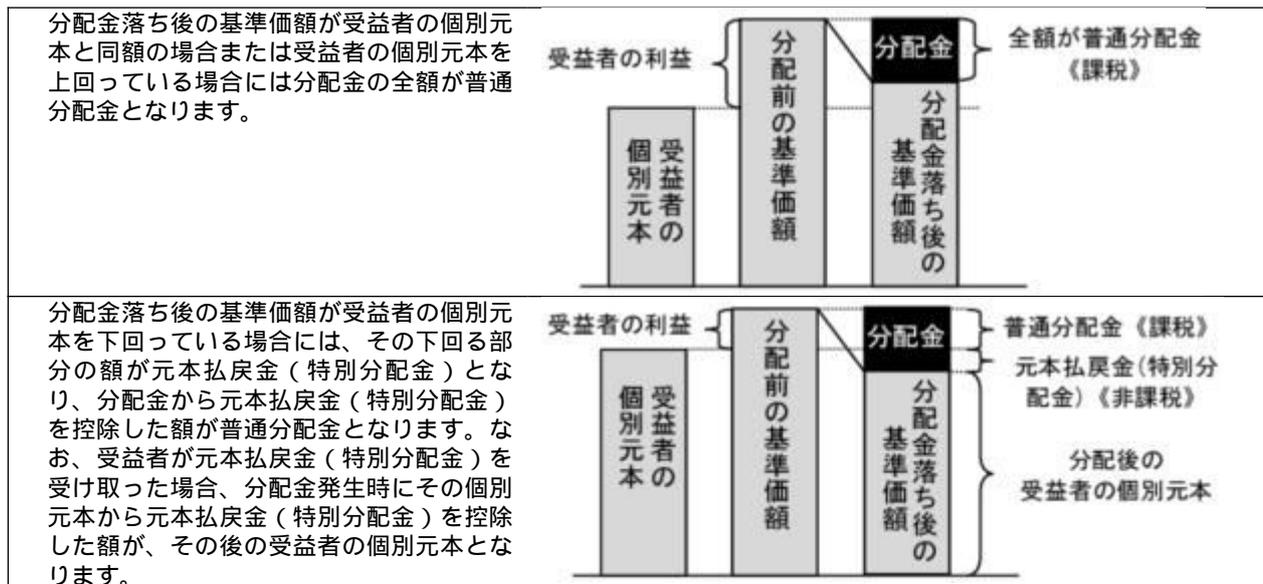
個別元本について

追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本をいいます。

受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合や受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合などには、当該受益者の個別元本が変わりますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。

分配金の課税について

分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）があります。



上図はあくまでもイメージ図であり、個別元本や基準価額、分配金の各水準等を示唆するものではありません。

- * 外貨建資産への投資により外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。
- * 税法が改正された場合等は、上記「(5)課税上の取扱い」の内容(2020年8月末現在)が変更になる場合があります。

5 運用状況

以下は2020年8月31日現在の運用状況であります。

また、投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1) 投資状況

野村外国債券（含む新興国）インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
-------	------	---------	---------

親投資信託受益証券	日本	20,985,713,332	99.96
現金・預金・その他資産（負債控除後）		6,348,096	0.03
合計（純資産総額）		20,992,061,428	100.00

（参考）外国債券マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	257,834,818,293	43.74
	カナダ	10,221,817,282	1.73
	メキシコ	4,380,263,555	0.74
	ドイツ	40,702,097,711	6.90
	イタリア	60,312,417,483	10.23
	フランス	58,890,263,468	9.99
	オランダ	10,113,161,451	1.71
	スペイン	39,737,429,254	6.74
	ベルギー	14,201,675,018	2.40
	オーストリア	8,050,935,103	1.36
	フィンランド	2,687,224,114	0.45
	アイルランド	6,586,453,083	1.11
	イギリス	38,388,514,526	6.51
	スウェーデン	1,778,764,104	0.30
	ノルウェー	1,300,344,924	0.22
	デンマーク	3,089,219,581	0.52
	ポーランド	3,511,998,034	0.59
	オーストラリア	13,855,442,848	2.35
	シンガポール	2,567,319,718	0.43
	マレーシア	2,913,385,190	0.49
イスラエル	2,284,294,661	0.38	
	小計	583,407,839,401	98.97
現金・預金・その他資産（負債控除後）		6,045,290,609	1.02
合計（純資産総額）		589,453,130,010	100.00

（参考）新興国債券マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	20,589,487,638	98.38
現金・預金・その他資産（負債控除後）		338,165,871	1.61
合計（純資産総額）		20,927,653,509	100.00

（2）投資資産

投資有価証券の主要銘柄

野村外国債券（含む新興国）インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （%）
1	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	7,120,209,673	2.4844	17,689,448,912	2.4613	17,524,972,068	83.48
2	日本	親投資信託 受益証券	新興国債券マザーファンド	1,743,007,436	2.0221	3,524,535,337	1.9855	3,460,741,264	16.48

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.96
合 計	99.96

（参考）外国債券マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	利率 （%）	償還期限	投資 比率 （%）
1	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	72,200,000	13,902.58	10,037,663,282	13,762.65	9,936,633,300	6	2026/2/15	1.68
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	80,800,000	10,948.30	8,846,228,997	10,876.36	8,788,099,902	2.5	2022/1/15	1.49
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	49,300,000	14,612.93	7,204,178,366	14,494.40	7,145,743,076	5.25	2028/11/15	1.21
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	46,200,000	14,719.12	6,800,233,774	14,596.47	6,743,571,617	5.5	2028/8/15	1.14
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	51,500,000	13,085.62	6,739,098,814	12,836.63	6,610,866,296	2.5	2046/2/15	1.12
6	スペイン	国債証券	SPANISH GOVERNMENT	31,800,000	19,571.96	6,223,884,645	20,235.80	6,434,984,909	5.75	2032/7/30	1.09
7	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	28,550,000	20,250.85	5,781,619,959	20,797.58	5,937,709,369	3.25	2045/5/25	1.00
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	50,300,000	11,593.71	5,831,638,827	11,594.53	5,832,052,726	2.25	2025/11/15	0.98
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	50,500,000	11,788.37	5,953,130,640	11,531.56	5,823,442,226	8	2021/11/15	0.98
10	イギリス	国債証券	UK TSY 3 1/4% 2044	27,450,000	22,395.32	6,147,517,398	21,119.81	5,797,388,778	3.25	2044/1/22	0.98
11	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	34,100,000	15,437.20	5,264,085,695	15,410.85	5,255,100,788	3.5	2026/4/25	0.89
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	47,900,000	10,979.66	5,259,258,858	10,943.44	5,241,910,675	1.75	2023/1/31	0.88
13	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	29,900,000	16,314.79	4,878,124,918	17,265.92	5,162,512,083	5.25	2029/11/1	0.87
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	37,100,000	14,127.10	5,241,156,052	13,905.87	5,159,078,965	3	2044/11/15	0.87
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	45,100,000	11,463.66	5,170,111,149	11,433.20	5,156,375,781	2.375	2024/8/15	0.87

16	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	39,900,000	13,015.51	5,193,190,695	12,799.59	5,107,037,696	2.5	2045/2/15	0.86
17	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	27,000,000	18,888.47	5,099,889,504	18,880.88	5,097,839,952	5.5	2029/4/25	0.86
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,600,000	11,459.54	4,881,766,478	11,401.92	4,857,221,115	2.75	2023/11/15	0.82
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,700,000	11,373.94	4,856,672,688	11,350.89	4,846,831,406	2.125	2024/9/30	0.82
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	43,000,000	11,299.03	4,858,585,516	11,259.52	4,841,596,216	2.25	2023/12/31	0.82
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	38,800,000	12,610.27	4,892,786,700	12,433.71	4,824,280,941	6.25	2023/8/15	0.81
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	30,200,000	15,691.25	4,738,758,578	15,496.97	4,680,086,023	5.375	2031/2/15	0.79
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	41,100,000	11,389.58	4,681,117,529	11,333.60	4,658,112,831	2.75	2023/7/31	0.79
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	38,000,000	11,882.63	4,515,400,350	11,861.23	4,507,267,675	2.375	2027/5/15	0.76
25	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	31,100,000	14,006.21	4,355,933,208	14,046.36	4,368,419,982	5.5	2022/11/1	0.74
26	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	20,100,000	21,301.31	4,281,564,904	21,429.50	4,307,330,628	5.75	2032/10/25	0.73
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	34,500,000	12,526.06	4,321,492,429	12,279.37	4,236,385,487	2.25	2046/8/15	0.71
28	イギリス	国債証券	UK TREASURY	18,440,000	23,550.04	4,342,627,455	22,145.00	4,083,539,125	3.5	2045/1/22	0.69
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	34,500,000	11,850.67	4,088,482,474	11,815.13	4,076,221,825	2.875	2025/4/30	0.69
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	27,500,000	14,721.59	4,048,437,349	14,585.77	4,011,088,125	5.25	2029/2/15	0.68

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.97
合計	98.97

(参考)新興国債券マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	アメリカ	国債証券	RUSSIAN FEDERATION	4,000,000	13,082.29	523,291,723	14,328.38	573,135,221	5.25	2047/6/23	2.73
2	アメリカ	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	2,600,000	10,533.16	273,862,248	11,819.23	307,300,035	5.625	2047/2/21	1.46
3	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	2,700,000	10,218.74	275,906,232	10,991.63	296,774,276	7.625	2029/4/26	1.41
4	アメリカ	国債証券	RUSSIAN FEDERATION	2,200,000	12,461.23	274,147,142	13,121.80	288,679,784	5.1	2035/3/28	1.37
5	アメリカ	国債証券	TURKEY GLOBAL	2,400,000	10,557.28	253,374,785	10,986.54	263,676,970	7.375	2025/2/5	1.25
6	アメリカ	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	2,300,000	11,095.98	255,207,733	11,369.02	261,487,663	4.25	2025/1/7	1.24
7	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF PERU	1,500,000	15,998.21	239,973,204	17,376.97	260,654,582	5.625	2050/11/18	1.24
8	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	2,200,000	11,077.64	243,708,216	11,841.14	260,505,234	4.5	2029/4/22	1.24

9	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	2,000,000	11,041.72	220,834,560	12,567.28	251,345,762	5	2045/6/15	1.20
10	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	1,810,000	12,020.52	217,571,455	13,503.72	244,417,473	6.05	2040/1/11	1.16
11	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF PHILIPPINES	2,000,000	12,184.30	243,686,090	12,205.27	244,105,423	3.7	2042/2/2	1.16
12	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	2,100,000	10,906.86	229,044,212	11,255.02	236,355,616	4	2024/2/26	1.12
13	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	2,300,000	9,513.11	218,801,586	10,235.82	235,424,075	6	2027/3/25	1.12
14	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,900,000	11,852.89	225,204,998	12,148.29	230,817,537	3.75	2029/1/14	1.10
15	アメリカ	国債証券	RUSSIAN FEDERATION	1,600,000	13,571.15	217,138,532	14,351.10	229,617,707	5.625	2042/4/4	1.09
16	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	1,700,000	11,397.42	193,756,197	12,998.89	220,981,221	5.55	2045/1/21	1.05
17	アメリカ	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,900,000	10,595.52	201,315,040	11,432.24	217,212,652	4.5	2029/5/30	1.03
18	アメリカ	国債証券	PHILIPPINES GLOBAL	1,250,000	16,945.74	211,821,828	17,315.84	216,448,093	9.5	2030/2/2	1.03
19	アメリカ	国債証券	PANAMA GLOBAL	1,350,000	14,241.46	192,259,769	15,612.19	210,764,594	6.7	2036/1/26	1.00
20	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF PANAMA	1,700,000	11,497.51	195,457,761	12,009.51	204,161,709	3.875	2028/3/17	0.97
21	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	1,750,000	11,133.27	194,832,239	11,461.53	200,576,862	4	2023/10/2	0.95
22	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	1,500,000	11,826.66	177,399,900	13,328.14	199,922,180	5.625	2044/2/26	0.95
23	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	2,100,000	8,618.66	180,992,044	9,516.86	199,854,128	6.625	2045/2/17	0.95
24	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF ARGENTINA	4,100,000	3,013.29	123,545,136	4,843.39	198,579,367	0	2026/4/22	0.94
25	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	1,700,000	10,129.73	172,205,441	11,599.24	197,187,087	4.6	2046/1/23	0.94
26	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	2,400,000	7,399.70	177,592,962	8,208.12	196,994,964	4.875	2043/4/16	0.94
27	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	1,700,000	10,088.22	171,499,740	11,524.22	195,911,810	4.6	2048/2/10	0.93
28	アメリカ	国債証券	INDONESIA GLOBAL	1,600,000	11,715.91	187,454,615	12,147.60	194,361,722	5.875	2024/1/15	0.92
29	アメリカ	国債証券	HUNGARY	1,600,000	11,774.13	188,386,146	12,143.16	194,290,583	5.375	2024/3/25	0.92
30	アメリカ	国債証券	RUSSIAN FEDERATION	1,600,000	11,719.30	187,508,854	12,134.84	194,157,576	4.375	2029/3/21	0.92

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.38
合計	98.38

投資不動産物件

野村外国債券（含む新興国）インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）

該当事項はありません。

（参考）外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新興国債券マザーファンド

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

野村外国債券（含む新興国）インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）

該当事項はありません。

（参考）外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新興国債券マザーファンド

該当事項はありません。

（3）運用実績

純資産の推移

野村外国債券（含む新興国）インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）

2020年8月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記特定期間末の純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1特定期間 (2018年 1月17日)	1,277	1,277	0.9942	0.9942
第2特定期間 (2018年 7月17日)	19,476	19,524	0.9705	0.9729
第3特定期間 (2019年 1月17日)	22,264	22,322	0.9258	0.9282
第4特定期間 (2019年 7月17日)	24,332	24,393	0.9517	0.9541
第5特定期間 (2020年 1月17日)	23,732	23,791	0.9745	0.9769
第6特定期間 (2020年 7月17日)	21,404	21,457	0.9808	0.9832
2019年 8月末日	23,908		0.9533	
9月末日	23,871		0.9569	
10月末日	23,935		0.9634	
11月末日	23,551		0.9632	
12月末日	23,582		0.9682	
2020年 1月末日	23,739		0.9747	
2月末日	23,027		0.9825	
3月末日	21,947		0.9620	
4月末日	21,357		0.9431	

5月末日	21,423		0.9640
6月末日	21,516		0.9772
7月末日	21,386		0.9823
8月末日	20,992		0.9809

分配の推移

野村外国債券（含む新興国）インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）

	計算期間	1口当たりの分配金
第1特定期間	2017年12月15日～2018年 1月17日	0.0000円
第2特定期間	2018年 1月18日～2018年 7月17日	0.0120円
第3特定期間	2018年 7月18日～2019年 1月17日	0.0144円
第4特定期間	2019年 1月18日～2019年 7月17日	0.0144円
第5特定期間	2019年 7月18日～2020年 1月17日	0.0144円
第6特定期間	2020年 1月18日～2020年 7月17日	0.0144円

各特定期間中の分配金単価の合計を表示しております。

収益率の推移

野村外国債券（含む新興国）インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）

	計算期間	収益率
第1特定期間	2017年12月15日～2018年 1月17日	0.6%
第2特定期間	2018年 1月18日～2018年 7月17日	1.2%
第3特定期間	2018年 7月18日～2019年 1月17日	3.1%
第4特定期間	2019年 1月18日～2019年 7月17日	4.4%
第5特定期間	2019年 7月18日～2020年 1月17日	3.9%
第6特定期間	2020年 1月18日～2020年 7月17日	2.1%

各特定期間中の分配金単価の合計を加算して算出しております。

各特定期間の収益率は、特定期間末の基準価額（期間中の分配金を加算した額）から当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数を記載しております。なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

（４）設定及び解約の実績

野村外国債券（含む新興国）インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1特定期間	2017年12月15日～2018年 1月17日	1,285,176,496		1,285,176,496
第2特定期間	2018年 1月18日～2018年 7月17日	19,694,099,183	911,175,347	20,068,100,332

第3特定期間	2018年 7月18日～2019年 1月17日	6,910,353,727	2,929,253,405	24,049,200,654
第4特定期間	2019年 1月18日～2019年 7月17日	3,932,734,173	2,414,040,192	25,567,894,635
第5特定期間	2019年 7月18日～2020年 1月17日	1,993,908,234	3,209,038,607	24,352,764,262
第6特定期間	2020年 1月18日～2020年 7月17日	1,433,894,591	3,962,465,305	21,824,193,548

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

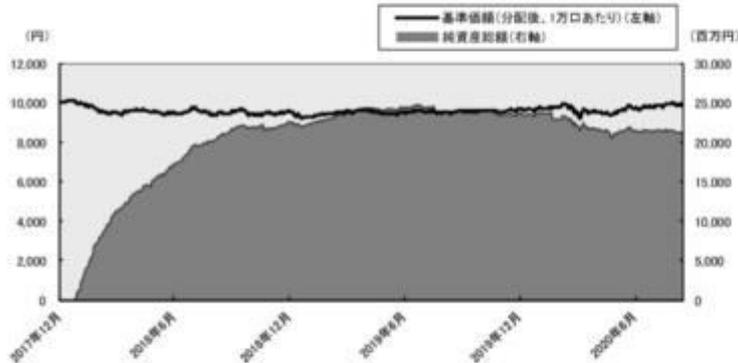
参考情報

< 更新後 >

運用実績 (2020年8月31日現在)

基準価額・純資産の推移

(日次:設定来)



分配の推移

(1万口あたり、課税前)

2020年8月	24 円
2020年7月	24 円
2020年6月	24 円
2020年5月	24 円
2020年4月	24 円
直近1年間累計	288 円
設定来累計	720 円

主要な資産の状況

銘柄別投資比率

銘柄	投資比率 (%)
外国債券マザーファンド	83.5
新興国債券マザーファンド	16.5

実質的な銘柄別投資比率(上位)

・「外国債券マザーファンド」を通じての投資銘柄

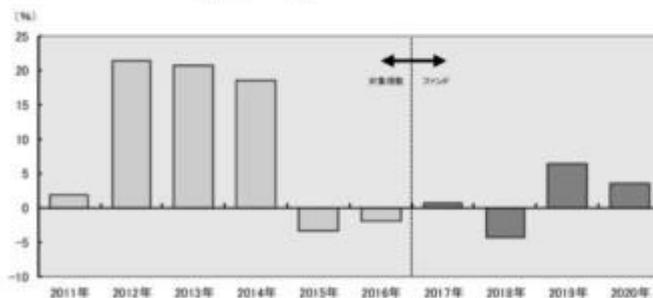
順位	銘柄	種類	投資比率 (%)
1	US TREASURY BOND	国債証券	1.4
2	US TREASURY N/B	国債証券	1.2
3	US TREASURY BOND	国債証券	1.0
4	US TREASURY BOND	国債証券	1.0
5	US TREASURY N/B	国債証券	0.9
6	SPANISH GOVERNMENT	国債証券	0.9
7	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	国債証券	0.8
8	US TREASURY N/B	国債証券	0.8
9	US TREASURY BOND	国債証券	0.8
10	UK TSY 3 1/4% 2044	国債証券	0.8

・「新興国債券マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率 (%)
1	RUSSIAN FEDERATION	国債証券	0.4
2	FED REPUBLIC OF BRAZIL	国債証券	0.2
3	REPUBLIC OF TURKEY	国債証券	0.2
4	RUSSIAN FEDERATION	国債証券	0.2
5	TURKEY GLOBAL	国債証券	0.2
6	FED REPUBLIC OF BRAZIL	国債証券	0.2
7	REPUBLIC OF PERU	国債証券	0.2
8	UNITED MEXICAN STATES	国債証券	0.2
9	REPUBLIC OF COLOMBIA	国債証券	0.2
10	UNITED MEXICAN STATES	国債証券	0.2

年間収益率の推移

(暦年ベース)



- ・ファンドの年間収益率は税引前分配金を再投資して算出。
- ・2011年から2016年は対象指数(合成指数)の年間収益率。
- ・2017年は設定日(2017年12月15日)から年末までのファンドの収益率。
- ・2020年は年初から運用実績作成基準日までのファンドの収益率。

●ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。●対象指数(合成指数)の情報はあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。●ファンドの運用状況は、別途、委託会社ホームページで開示している場合があります。

第3【ファンドの経理状況】

(1)当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)(以下「財務諸表等規則」という。)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)(以下「投資信託財産計算規則」という。)に基づいて作成しております。なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドの計算期間は6ヶ月未満であるため、財務諸表は原則として6ヶ月毎に作成しております。

(3)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当期(2020年1月18日から2020年7月17日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1 財務諸表

野村外国債券（含む新興国）インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）

(1) 貸借対照表

	前期 (2020年 1月17日現在)	当期 (2020年 7月17日現在)
(単位：円)		
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	55,356,869	33,075,083
親投資信託受益証券	23,722,105,339	21,395,827,587
未収入金	61,483,196	65,854,918
流動資産合計	23,838,945,404	21,494,757,588
資産合計	23,838,945,404	21,494,757,588
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	58,446,634	52,378,064
未払解約金	41,162,388	31,595,640
未払受託者報酬	658,821	578,513
未払委託者報酬	5,929,366	5,206,633
未払利息	41	38
その他未払費用	43,913	38,557
流動負債合計	106,241,163	89,797,445
負債合計	106,241,163	89,797,445
純資産の部		
元本等		
元本	24,352,764,262	21,824,193,548
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	620,060,021	419,233,405
（分配準備積立金）	465,687,723	546,149,237
元本等合計	23,732,704,241	21,404,960,143
純資産合計	23,732,704,241	21,404,960,143
負債純資産合計	23,838,945,404	21,494,757,588

(2) 損益及び剰余金計算書

	前期 自 2019年 7月18日 至 2020年 1月17日	当期 自 2020年 1月18日 至 2020年 7月17日
(単位：円)		
営業収益		
有価証券売買等損益	951,671,831	456,593,376
営業収益合計	951,671,831	456,593,376

	前期 自 2019年 7月18日 至 2020年 1月17日	当期 自 2020年 1月18日 至 2020年 7月17日
営業費用		
支払利息	13,753	9,313
受託者報酬	3,925,611	3,612,085
委託者報酬	35,330,447	32,508,756
その他費用	261,651	240,751
営業費用合計	39,531,462	36,370,905
営業利益又は営業損失（ ）	912,140,369	420,222,471
経常利益又は経常損失（ ）	912,140,369	420,222,471
当期純利益又は当期純損失（ ）	912,140,369	420,222,471
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	821,405	2,360,000
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,235,525,892	620,060,021
剰余金増加額又は欠損金減少額	143,539,797	163,342,206
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	143,539,797	163,342,206
剰余金減少額又は欠損金増加額	85,260,931	55,060,944
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	85,260,931	55,060,944
分配金	355,774,769	325,317,117
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	620,060,021	419,233,405

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4. その他	当該財務諸表の特定期間は、2020年 1月18日から2020年 7月17日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

前期 2020年 1月17日現在	当期 2020年 7月17日現在
1. 特定期間の末日における受益権の総数 24,352,764,262口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 21,824,193,548口
2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 620,060,021円	2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 419,233,405円
3. 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.9745円 (10,000口当たり純資産額) (9,745円)	3. 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.9808円 (10,000口当たり純資産額) (9,808円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

前期 自 2019年 7月18日 至 2020年 1月17日			当期 自 2020年 1月18日 至 2020年 7月17日		
1. 分配金の計算過程			1. 分配金の計算過程		
2019年 7月18日から2019年 8月19日まで			2020年 1月18日から2020年 2月17日まで		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	64,987,489円	費用控除後の配当等収益額	A	56,631,710円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	146,602,135円	収益調整金額	C	159,659,230円
分配準備積立金額	D	188,877,288円	分配準備積立金額	D	443,787,613円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	400,466,912円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	660,078,553円
当ファンドの期末残存口数	F	25,089,637,811口	当ファンドの期末残存口数	F	23,437,090,141口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	159円	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	281円
10,000口当たり分配金額	H	24円	10,000口当たり分配金額	H	24円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	60,215,130円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	56,249,016円
2019年 8月20日から2019年 9月17日まで			2020年 2月18日から2020年 3月17日まで		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	56,070,502円	費用控除後の配当等収益額	A	49,357,029円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	148,940,898円	収益調整金額	C	164,458,176円
分配準備積立金額	D	191,424,730円	分配準備積立金額	D	437,708,002円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	396,436,130円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	651,523,207円
当ファンドの期末残存口数	F	25,018,655,564口	当ファンドの期末残存口数	F	23,333,414,776口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	158円	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	279円
10,000口当たり分配金額	H	24円	10,000口当たり分配金額	H	24円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	60,044,773円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	56,000,195円
2019年 9月18日から2019年10月17日まで			2020年 3月18日から2020年 4月17日まで		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	61,334,840円	費用控除後の配当等収益額	A	60,454,457円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	150,244,940円	収益調整金額	C	162,918,976円
分配準備積立金額	D	185,040,195円	分配準備積立金額	D	416,925,446円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	396,619,975円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	640,298,879円
当ファンドの期末残存口数	F	24,870,985,449口	当ファンドの期末残存口数	F	22,677,577,725口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	159円	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	282円
10,000口当たり分配金額	H	24円	10,000口当たり分配金額	H	24円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	59,690,365円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	54,426,186円
2019年10月18日から2019年11月18日まで			2020年 4月18日から2020年 5月18日まで		

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	57,915,297円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	151,287,458円
分配準備積立金額	D	182,191,160円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	391,393,915円
当ファンドの期末残存口数	F	24,493,867,999口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	159円
10,000口当たり分配金額	H	24円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	58,785,283円

2019年11月19日から2019年12月17日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	58,658,825円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	61,416,459円
収益調整金額	C	154,810,007円
分配準備積立金額	D	178,028,192円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	452,913,483円
当ファンドの期末残存口数	F	24,413,577,018口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	185円
10,000口当たり分配金額	H	24円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	58,592,584円

2019年12月18日から2020年 1月17日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	62,688,955円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	225,346,088円
収益調整金額	C	158,655,082円
分配準備積立金額	D	236,099,314円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	682,789,439円
当ファンドの期末残存口数	F	24,352,764,262口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	280円
10,000口当たり分配金額	H	24円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	58,446,634円

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	49,806,536円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	168,933,791円
分配準備積立金額	D	407,167,948円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	625,908,275円
当ファンドの期末残存口数	F	22,241,334,972口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	281円
10,000口当たり分配金額	H	24円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	53,379,203円

2020年 5月19日から2020年 6月17日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	52,770,193円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	169,842,728円
分配準備積立金額	D	398,401,991円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	621,014,912円
当ファンドの期末残存口数	F	22,035,188,858口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	281円
10,000口当たり分配金額	H	24円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	52,884,453円

2020年 6月18日から2020年 7月17日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	39,502,679円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	166,478,100円
収益調整金額	C	170,764,302円
分配準備積立金額	D	392,546,522円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	769,291,603円
当ファンドの期末残存口数	F	21,824,193,548口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	352円
10,000口当たり分配金額	H	24円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	52,378,064円

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

前期	当期
自 2019年 7月18日 至 2020年 1月17日	自 2020年 1月18日 至 2020年 7月17日

<p>1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。 これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。 市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。 信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。 流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>	<p>1.金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制 同左</p>
---	---

(2)金融商品の時価等に関する事項

前期 2020年 1月17日現在	当期 2020年 7月17日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2.時価の算定方法 親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2.時価の算定方法 同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

前期 自 2019年 7月18日 至 2020年 1月17日	当期 自 2020年 1月18日 至 2020年 7月17日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はございません。	同左

(その他の注記)

1 元本の移動

前期 自 2019年 7月18日 至 2020年 1月17日	当期 自 2020年 1月18日 至 2020年 7月17日
期首元本額 25,567,894,635円	期首元本額 24,352,764,262円
期中追加設定元本額 1,993,908,234円	期中追加設定元本額 1,433,894,591円
期中一部解約元本額 3,209,038,607円	期中一部解約元本額 3,962,465,305円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	前期 自 2019年 7月18日 至 2020年 1月17日	当期 自 2020年 1月18日 至 2020年 7月17日
	損益に含まれた評価差額(円)	損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	295,004,098	278,126,013
合計	295,004,098	278,126,013

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

(4) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2020年7月17日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2020年7月17日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	日本円	外国債券マザーファンド	7,290,432,096	17,900,197,925	

親投資信託受益証券	小計	新興国債券マザーファンド	1,769,491,097	3,495,629,662
		銘柄数：2	9,059,923,193	21,395,827,587
		組入時価比率：100.0%		100.0%
合計				21,395,827,587

(注1)投資信託受益証券、投資証券及び親投資信託受益証券における券面総額の数値は、証券数を表示しております。

(注2)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは「外国債券マザーファンド」および「新興国債券マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

外国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2020年 7月17日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	146,125,576
コール・ローン	588,040,488
国債証券	582,163,360,083
派生商品評価勘定	15,325
未収入金	544,381,344
未収利息	4,800,335,489
前払費用	389,149,013
その他未収収益	6,424,423
流動資産合計	588,637,831,741
資産合計	588,637,831,741
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	605,653
未払金	32,782,422
未払解約金	1,095,533,428
未払利息	683
その他未払費用	4,304,728
流動負債合計	1,133,226,914
負債合計	1,133,226,914
純資産の部	
元本等	
元本	239,276,409,935
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	348,228,194,892
元本等合計	587,504,604,827
純資産合計	587,504,604,827
負債純資産合計	588,637,831,741

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 費用・収益の計上基準	<p>有価証券売買等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。</p>

（貸借対照表に関する注記）

2020年 7月17日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	2.4553円
(10,000口当たり純資産額)	(24,553円)
2. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券	150,648,455,135円
なお、上記の金額は利含み価格で表示しております。	
3. 自由処分権を有する担保受入金融資産の時価	
貸付有価証券の担保として受け入れている資産は次の通りであります。	
有価証券	158,478,182,616円
なお、上記の金額は利含み価格で表示しております。	

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2020年 1月18日 至 2020年 7月17日	
1. 金融商品に対する取組方針	
<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>	
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	

当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。

当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。

3.金融商品に係るリスク管理体制

委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。

市場リスクの管理

市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。

信用リスクの管理

信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。

流動性リスクの管理

流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。

(2)金融商品の時価等に関する事項

2020年 7月17日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
国債証券	(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。
派生商品評価勘定	
デリバティブ取引については、	附属明細表に記載しております。
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており	
ます。	

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

2020年 7月17日現在	
期首	2020年 1月18日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	260,051,782,550円
同期中における追加設定元本額	17,207,292,066円
同期中における一部解約元本額	37,982,664,681円
期末元本額	239,276,409,935円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	81,130,141円
バランスセレクト50	81,868,147円
バランスセレクト70	68,244,143円
野村外国債券インデックスファンド	288,778,393円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	3,516,288,272円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	23,143,955,545円

野村世界6資産分散投信（成長コース）	1,463,113,700円
野村資産設計ファンド2015	20,393,667円
野村資産設計ファンド2020	20,871,927円
野村資産設計ファンド2025	36,015,955円
野村資産設計ファンド2030	34,863,014円
野村資産設計ファンド2035	24,097,252円
野村資産設計ファンド2040	44,294,918円
野村外国債券インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）	101,417,693,823円
のむらっぴ・ファンド（保守型）	5,632,642,140円
のむらっぴ・ファンド（普通型）	12,070,292,486円
のむらっぴ・ファンド（積極型）	2,503,691,626円
野村外国債券インデックス（野村SMA向け）	588,089,806円
野村資産設計ファンド2045	5,761,221円
野村インデックスファンド・外国債券	801,832,831円
マイ・ロード	8,664,115,760円
ネクストコア	224,617,607円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	150,812,245円
野村外国債券インデックスBコース（野村SMA・EW向け）	6,214,729,026円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	1,241,436,860円
野村資産設計ファンド2050	7,263,702円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	4,524,246円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	1,733,367円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	1,228,106円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	828,409円
のむらっぴ・ファンド（やや保守型）	520,439,256円
のむらっぴ・ファンド（やや積極型）	373,734,646円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,942,259円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,346,277円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	5,474,290円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,477,978円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	3,450,438円
野村6資産均等バランス	888,140,619円
野村外国債券（含む新興国）インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）	7,290,432,096円
世界6資産分散ファンド	75,230,383円
野村資産設計ファンド2060	2,060,129円
NEXT FUNDS 外国債券・FTSE世界国債インデックス（除く日本・為替ヘッジなし）連動型上場投信	1,943,358,210円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国債券	1,518,726,008円
野村外国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	9,008,220円
グローバル・インデックス・バランス25VA（適格機関投資家専用）	1,327,720,758円
グローバル・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	305,488,806円
グローバル・インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	1,501,434,150円
グローバル・インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	1,215,485,712円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型（適格機関投資家専用）	2,560,305円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型（適格機関投資家専用）	9,032,397円
ワールド・インデックス・ファンドVA積極型（適格機関投資家専用）	225,555円
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	3,079,835,339円
野村ワールド・インデックス・バランス35VA（適格機関投資家専用）	13,697,992円

野村ワールド・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	70,564,340円
野村世界インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	16,157,365円
野村グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用)	159,944,535円
野村グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	173,124,854円
野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用)	1,710,212,282円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	102,344,210円
ノムラ外国債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	653,815,483円
ノムラFOFs用インデックスファンド・外国債券(適格機関投資家専用)	1,627,601,954円
野村FOFs用・ターゲット・リターン・8資産バランス(2%コース向け)(適格機関投資家専用)	1,390,434円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	3,706,775円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	6,378,665円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	5,276,502円
野村外国債券パッシブファンド(確定拠出年金向け)	584,525,881円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	5,022,762,903円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	5,668,600,767円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	4,058,591,467円
野村外国債券インデックスファンド(確定拠出年金向け)	16,756,317,222円
マイバランスDC30	1,665,974,147円
マイバランスDC50	1,149,151,925円
マイバランスDC70	727,100,852円
野村DC外国債券インデックスファンド	6,252,021,843円
野村DC運用戦略ファンド	3,434,053,260円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	328,337,110円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	147,166,151円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	221,683,240円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	105,441,750円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	9,868,691円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	24,311,914円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	8,990,229円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	3,608,674円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	2,189,150円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	1,326,951円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	56,303,905円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	36,418,548円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	16,137,601円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	19,028,157円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	470,040円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2020年7月17日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2020年7月17日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY BOND	50,500,000.00	55,772,907.00	
		US TREASURY BOND	38,800,000.00	46,059,840.84	
		US TREASURY BOND	45,100,000.00	49,028,629.43	
		US TREASURY BOND	72,200,000.00	94,813,263.82	
		US TREASURY BOND	10,800,000.00	15,244,875.00	
		US TREASURY BOND	46,200,000.00	64,470,653.94	
		US TREASURY BOND	49,300,000.00	68,303,606.91	
		US TREASURY BOND	27,500,000.00	38,429,099.50	
		US TREASURY BOND	100,000.00	156,539.06	
		US TREASURY BOND	17,500,000.00	23,336,523.00	
		US TREASURY BOND	2,000,000.00	3,033,750.00	
		US TREASURY N/B	32,800,000.00	33,432,935.04	
		US TREASURY N/B	500,000.00	504,726.55	
		US TREASURY N/B	18,700,000.00	18,965,158.52	
		US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,586,542.75	
		US TREASURY N/B	11,400,000.00	11,648,483.52	
		US TREASURY N/B	4,300,000.00	4,344,007.49	
		US TREASURY N/B	26,100,000.00	26,659,722.33	
		US TREASURY N/B	12,200,000.00	12,453,530.64	
		US TREASURY N/B	17,900,000.00	18,322,327.23	
		US TREASURY N/B	9,650,000.00	9,762,708.14	
		US TREASURY N/B	30,400,000.00	31,114,874.24	
		US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,926,125.00	
		US TREASURY N/B	13,000,000.00	13,218,866.70	
		US TREASURY N/B	7,500,000.00	7,681,347.00	
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,023,320.30	
		US TREASURY N/B	3,700,000.00	3,779,202.94	
		US TREASURY N/B	12,400,000.00	12,746,811.88	
		US TREASURY N/B	6,700,000.00	6,876,921.54	
		US TREASURY N/B	80,000,000.00	82,778,120.00	
US TREASURY N/B	6,400,000.00	6,530,999.68			

US TREASURY N/B	14,000,000.00	14,365,311.80	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,342,136.69	
US TREASURY N/B	32,800,000.00	33,754,529.20	
US TREASURY N/B	6,800,000.00	6,973,718.24	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,595,976.30	
US TREASURY N/B	3,900,000.00	4,003,898.34	
US TREASURY N/B	500,000.00	514,531.25	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,347,277.23	
US TREASURY N/B	32,800,000.00	33,735,311.68	
US TREASURY N/B	25,300,000.00	26,072,834.04	
US TREASURY N/B	8,800,000.00	9,054,030.48	
US TREASURY N/B	200,000.00	206,468.74	
US TREASURY N/B	900,000.00	926,648.37	
US TREASURY N/B	16,400,000.00	17,034,217.52	
US TREASURY N/B	100,000.00	103,109.37	
US TREASURY N/B	100,000.00	103,765.62	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,035,000.00	
US TREASURY N/B	900,000.00	927,527.31	
US TREASURY N/B	19,100,000.00	19,798,343.75	
US TREASURY N/B	900,000.00	931,710.87	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,562,812.50	
US TREASURY N/B	7,600,000.00	7,857,984.28	
US TREASURY N/B	10,200,000.00	10,689,280.74	
US TREASURY N/B	47,900,000.00	49,830,968.75	
US TREASURY N/B	400,000.00	418,812.48	
US TREASURY N/B	20,000,000.00	20,703,124.00	
US TREASURY N/B	14,300,000.00	15,217,210.58	
US TREASURY N/B	400,000.00	414,500.00	
US TREASURY N/B	15,000,000.00	15,608,202.00	
US TREASURY N/B	34,800,000.00	36,352,403.64	
US TREASURY N/B	9,200,000.00	9,584,530.56	
US TREASURY N/B	4,800,000.00	4,957,124.64	
US TREASURY N/B	41,100,000.00	44,307,723.48	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,965,663.90	
US TREASURY N/B	10,900,000.00	11,307,046.33	

US TREASURY N/B	35,200,000.00	36,550,247.36	
US TREASURY N/B	11,800,000.00	12,358,655.66	
US TREASURY N/B	42,600,000.00	46,201,029.12	
US TREASURY N/B	9,200,000.00	9,799,437.04	
US TREASURY N/B	30,000,000.00	32,702,343.00	
US TREASURY N/B	43,000,000.00	46,043,591.60	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,405,421.81	
US TREASURY N/B	800,000.00	873,124.96	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,820,859.29	
US TREASURY N/B	20,900,000.00	22,728,750.00	
US TREASURY N/B	17,700,000.00	18,944,531.25	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	4,089,156.06	
US TREASURY N/B	42,700,000.00	46,085,973.36	
US TREASURY N/B	3,600,000.00	3,909,093.48	
US TREASURY N/B	34,200,000.00	37,163,108.52	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,488,851.39	
US TREASURY N/B	16,900,000.00	18,244,077.28	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	2,117,609.28	
US TREASURY N/B	32,700,000.00	36,309,772.62	
US TREASURY N/B	34,500,000.00	38,788,239.60	
US TREASURY N/B	8,050,000.00	8,763,807.99	
US TREASURY N/B	4,100,000.00	4,596,484.17	
US TREASURY N/B	27,000,000.00	29,326,638.60	
US TREASURY N/B	19,200,000.00	21,878,999.04	
US TREASURY N/B	50,300,000.00	55,451,816.54	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,142,500.00	
US TREASURY N/B	8,600,000.00	9,596,389.98	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,930,921.74	
US TREASURY N/B	21,100,000.00	22,522,599.98	
US TREASURY N/B	12,000,000.00	12,714,374.40	
US TREASURY N/B	5,600,000.00	6,025,250.00	
US TREASURY N/B	13,000,000.00	14,294,920.90	
US TREASURY N/B	30,000,000.00	32,294,529.00	
US TREASURY N/B	11,300,000.00	12,640,991.34	
US TREASURY N/B	17,000,000.00	17,066,405.40	

US TREASURY N/B	38,000,000.00	42,954,842.80	
US TREASURY N/B	8,400,000.00	9,442,781.04	
US TREASURY N/B	500,000.00	584,375.00	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	2,125,968.66	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,452,562.44	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,166,406.20	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	2,624,773.31	
US TREASURY N/B	34,100,000.00	50,762,378.48	
US TREASURY N/B	15,450,000.00	23,849,729.31	
US TREASURY N/B	200,000.00	330,234.36	
US TREASURY N/B	100,000.00	159,515.62	
US TREASURY N/B	100,000.00	143,281.25	
US TREASURY N/B	100,000.00	156,460.93	
US TREASURY N/B	100,000.00	161,289.06	
US TREASURY N/B	100,000.00	158,710.93	
US TREASURY N/B	100,000.00	164,289.06	
US TREASURY N/B	100,000.00	160,148.43	
US TREASURY N/B	200,000.00	301,125.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	157,882.81	
US TREASURY N/B	100,000.00	167,656.25	
US TREASURY N/B	100,000.00	161,570.31	
US TREASURY N/B	100,000.00	149,882.81	
US TREASURY N/B	300,000.00	413,648.43	
US TREASURY N/B	100,000.00	138,250.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	135,054.68	
US TREASURY N/B	200,000.00	261,578.12	
US TREASURY N/B	1,290,000.00	1,783,828.12	
US TREASURY N/B	100,000.00	148,890.62	
US TREASURY N/B	7,400,000.00	11,046,233.82	
US TREASURY N/B	15,200,000.00	21,918,874.24	
US TREASURY N/B	23,000,000.00	32,002,342.60	
US TREASURY N/B	36,900,000.00	50,434,801.92	
US TREASURY N/B	39,400,000.00	49,634,764.64	
US TREASURY N/B	21,900,000.00	30,020,964.57	
US TREASURY N/B	17,500,000.00	23,551,171.00	

	US TREASURY N/B	3,700,000.00	5,092,702.94	
	US TREASURY N/B	51,500,000.00	65,211,875.00	
	US TREASURY N/B	28,200,000.00	35,769,937.50	
	US TREASURY N/B	34,500,000.00	41,868,982.65	
	US TREASURY N/B	14,200,000.00	19,298,687.50	
	US TREASURY N/B	1,700,000.00	2,353,304.56	
	US TREASURY N/B	11,400,000.00	15,144,187.50	
	US TREASURY N/B	9,300,000.00	12,454,733.91	
	US TREASURY N/B	9,500,000.00	13,310,390.15	
	US TREASURY N/B	5,100,000.00	7,311,726.18	
	US TREASURY N/B	10,500,000.00	14,769,726.30	
	US TREASURY N/B	2,470,000.00	3,467,648.31	
	US TREASURY N/B	100,000.00	138,460.93	
	US TREASURY N/B	9,400,000.00	11,506,187.50	
	US TREASURY N/B	300,000.00	377,203.11	
小計	銘柄数：151	2,134,010,000.00	2,456,382,677.29 (263,520,733,619)	
	組入時価比率：44.9%		45.3%	
カナダドル	CANADA GOVERNMENT	5,500,000.00	5,759,270.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	11,600,000.00	11,760,660.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,006,480.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	301,428.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	10,400,000.00	10,568,688.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	311,712.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,460,000.00	4,617,616.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,100,000.00	1,159,004.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	500,000.00	535,340.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	6,800,000.00	7,376,980.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	17,000,000.00	17,730,320.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,700,000.00	4,043,878.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	320,112.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	7,250,000.00	10,978,530.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	208,370.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	112,228.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	10,080,000.00	14,711,457.60	

小計	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,156,250.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	5,700,000.00	9,266,889.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,800,000.00	6,315,638.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	7,100,000.00	11,291,840.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	9,950,000.00	15,620,107.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,867,827.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	763,404.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	162,949.00	
	銘柄数：25	110,140,000.00	137,946,978.00	
組入時価比率：1.9%		(10,901,949,671)	1.9%	
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	84,700,000.00	87,737,833.26	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	44,400,000.00	45,937,722.96	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	300,000.00	315,813.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	53,300,000.00	59,596,329.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	40,000,000.00	48,088,000.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	51,300,000.00	52,777,953.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	112,300,000.00	125,543,539.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	45,300,000.00	54,193,296.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	83,500,000.00	95,766,150.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,000,000.00	11,524,600.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	56,300,000.00	77,196,308.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	35,800,000.00	43,396,044.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	66,500,000.00	74,558,470.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	43,000,000.00	49,279,290.00	
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	87,100,000.00	96,061,719.00	
	銘柄数：15	813,800,000.00	921,973,067.22	
組入時価比率：0.8%		(4,416,250,991)	0.8%	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	700,000.00	740,502.00	
	BELGIUM KINGDOM	800,000.00	863,516.00	
	BELGIUM KINGDOM	600,000.00	663,960.00	
	BELGIUM KINGDOM	11,100,000.00	12,045,320.40	
	BELGIUM KINGDOM	2,900,000.00	2,975,980.00	
	BELGIUM KINGDOM	4,000,000.00	4,504,800.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,045,805.00	

BELGIUM KINGDOM	3,000,000.00	3,200,918.70
BELGIUM KINGDOM	6,000,000.00	7,722,564.00
BELGIUM KINGDOM	3,300,000.00	3,588,538.80
BELGIUM KINGDOM	2,000,000.00	2,166,098.00
BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,090,522.00
BELGIUM KINGDOM	3,000,000.00	3,313,038.00
BELGIUM KINGDOM	1,500,000.00	1,683,487.50
BELGIUM KINGDOM	3,500,000.00	5,178,600.00
BELGIUM KINGDOM	100,000.00	116,430.00
BELGIUM KINGDOM	500,000.00	603,450.00
BELGIUM KINGDOM	100,000.00	129,071.80
BELGIUM KINGDOM	3,400,000.00	6,040,865.00
BELGIUM KINGDOM	4,000,000.00	7,106,056.00
BELGIUM KINGDOM	5,200,000.00	6,621,602.00
BELGIUM KINGDOM	4,000,000.00	5,270,532.00
BELGIUM KINGDOM	1,200,000.00	1,852,138.80
BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,596,464.00
BELGIUM KINGDOM GOVT	11,500,000.00	16,742,252.00
BELGIUM KINGDOM GOVT	11,000,000.00	18,898,079.20
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,100,000.00	5,163,291.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	10,700,000.00	10,767,131.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	18,650,000.00	20,450,340.45
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,350,000.00	4,410,726.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	3,057,000.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	15,100,000.00	17,317,102.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,200,000.00	4,286,650.20
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,300,000.00	6,130,451.70
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	14,600,000.00	17,254,615.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,900,000.00	7,973,295.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	508,087.35
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	977,382.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	15,100,000.00	18,782,708.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,000,000.00	5,607,160.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,000,000.00	4,475,540.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	22,400,000.00	30,480,363.20

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,100,000.00	3,397,290.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,000,000.00	2,195,898.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,000,000.00	5,491,000.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	9,300,000.00	13,083,240.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,000,000.00	2,316,022.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,400,000.00	6,600,420.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,500,000.00	2,599,465.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,700,000.00	9,786,934.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	9,100,000.00	17,069,584.35	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,200,000.00	4,497,347.84	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	8,800,000.00	12,071,356.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	5,061,873.00	
BUNDES OblIGATION	100,000.00	100,798.00	
BUNDES OblIGATION	3,700,000.00	3,743,068.00	
BUNDES OblIGATION	750,000.00	761,700.00	
BUNDES OblIGATION	1,000,000.00	1,019,890.00	
BUNDES OblIGATION	2,000,000.00	2,059,760.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	350,000.00	363,135.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	400,000.00	413,264.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,000,000.00	4,193,240.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	733,306.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	390,000.00	412,530.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,200,000.00	9,777,668.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,580,000.00	2,798,164.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	23,900,000.00	29,723,235.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,700,000.00	1,851,810.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10,800,000.00	11,724,048.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,100,000.00	8,669,754.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,700,000.00	2,851,119.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,100,000.00	9,894,612.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	20,800,000.00	22,214,816.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,042,270.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	743,078.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	20,200,000.00	30,478,568.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	216,642.00	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	18,200,000.00	26,893,048.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	600,000.00	652,548.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,300,000.00	10,491,122.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	19,200,000.00	31,892,160.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,200,000.00	10,190,072.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,600,000.00	14,950,059.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,400,000.00	14,509,236.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,800,000.00	7,126,482.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,200,000.00	12,533,126.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,430,000.00	2,534,128.74	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,800,000.00	9,532,387.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	11,200,000.00	18,884,544.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	12,950,000.00	17,764,810.00	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	1,500,000.00	1,514,160.00	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	1,700,000.00	1,719,210.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	8,318,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,500,000.00	17,392,650.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,900,000.00	6,074,050.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,050,000.00	10,102,260.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,600,000.00	2,681,952.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,900,000.00	20,430,900.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,200,000.00	6,320,838.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,900,000.00	1,942,104.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	406,480.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,200,000.00	9,137,260.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,100,000.00	3,189,571.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	31,100,000.00	34,884,870.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,900,000.00	1,894,965.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	102,020.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,100,000.00	1,230,889.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	567,750.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,700,000.00	23,986,490.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,700,000.00	16,832,970.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	315,630.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,800,000.00	6,559,800.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	4,700,000.00	4,887,530.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,083,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,800,000.00	20,178,278.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	829,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,128,660.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,000,000.00	7,663,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,207,300.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,500,000.00	13,867,850.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	2,152,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,100,000.00	25,200,630.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	17,500,000.00	24,256,750.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,800,000.00	7,482,580.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	29,900,000.00	40,792,570.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,000,000.00	23,558,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	518,150.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,900,000.00	16,276,970.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,400,000.00	1,566,460.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	15,400,000.00	22,071,280.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	9,839,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	929,040.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	587,450.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,000,000.00	7,555,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	240,840.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,700,000.00	17,786,340.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,800,000.00	13,383,920.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,500,000.00	6,819,450.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,800,000.00	3,582,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,000,000.00	9,607,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	9,000,000.00	9,682,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,700,000.00	1,937,673.60	
FINNISH GOVERNMENT	500,000.00	505,425.00	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	104,927.60	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	105,900.50	
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	408,038.40	
FINNISH GOVERNMENT	700,000.00	769,720.00	

FINNISH GOVERNMENT	3,600,000.00	4,433,760.00	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	107,525.00	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,118,396.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,300,000.00	4,138,173.60	
FINNISH GOVERNMENT	2,400,000.00	2,579,227.20	
FINNISH GOVERNMENT	800,000.00	884,783.20	
FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	233,687.60	
FINNISH GOVERNMENT	4,000,000.00	4,091,816.00	
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	623,549.60	
FINNISH GOVERNMENT	300,000.00	396,773.40	
FRANCE (GOVT OF)	6,000,000.00	6,061,802.40	
FRANCE (GOVT OF)	2,600,000.00	2,643,940.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,570,000.00	1,677,482.20	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	102,210.00	
FRANCE (GOVT OF)	9,600,000.00	10,666,214.40	
FRANCE (GOVT OF)	1,800,000.00	1,846,803.60	
FRANCE (GOVT OF)	11,000,000.00	11,571,450.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,800,000.00	1,905,602.40	
FRANCE (GOVT OF)	13,300,000.00	13,898,194.10	
FRANCE (GOVT OF)	7,700,000.00	8,453,830.00	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	2,174,212.00	
FRANCE (GOVT OF)	11,600,000.00	12,641,587.20	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	2,138,954.00	
FRANCE (GOVT OF)	9,500,000.00	12,069,598.00	
FRANCE (GOVT OF)	10,500,000.00	12,266,446.50	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	117,410.00	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	128,290.80	
FRANCE (GOVT OF)	10,600,000.00	14,863,903.00	
FRANCE (GOVT OF)	2,500,000.00	3,185,075.00	
FRANCE (GOVT OF)	500,000.00	527,696.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,300,000.00	1,364,225.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8,500,000.00	9,050,375.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,400,000.00	3,440,355.28	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	19,100,000.00	20,360,097.67	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	10,900,000.00	13,653,340.00	

FRANCE GOVERNMENT O.A.T	27,000,000.00	31,355,100.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,000,000.00	3,308,787.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	19,800,000.00	26,660,700.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,000,000.00	6,496,800.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	34,100,000.00	42,045,300.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,000,000.00	3,697,500.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	27,000,000.00	40,842,900.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	13,500,000.00	15,935,116.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	20,100,000.00	34,537,830.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	10,300,000.00	17,455,039.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	300,000.00	504,930.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,900,000.00	14,620,530.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	29,450,000.00	49,345,713.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,900,000.00	10,223,164.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,700,000.00	10,363,735.00	
IRISH GOVERNMENT	2,430,000.00	3,097,552.59	
IRISH GOVERNMENT	4,000,000.00	4,356,804.80	
IRISH TSY 0.8% 2022	1,200,000.00	1,227,624.12	
IRISH TSY 1.10% 2029	600,000.00	666,700.80	
IRISH TSY 1.3% 2033	2,400,000.00	2,776,909.20	
IRISH TSY 1.35% 2031	2,000,000.00	2,297,020.00	
IRISH TSY 1.5% 2050	1,500,000.00	1,878,357.75	
IRISH TSY 1.7% 2037	700,000.00	865,753.00	
IRISH TSY 1% 2026	4,600,000.00	4,969,665.20	
IRISH TSY 2.4% 2030	3,700,000.00	4,609,497.00	
IRISH TSY 2% 2045	3,100,000.00	4,236,840.99	
IRISH TSY 2022	9,000,000.00	9,115,362.00	
IRISH TSY 3.4% 2024	6,100,000.00	6,978,766.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	50,000.00	51,900.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	1,514,100.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	100,000.00	105,825.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT	200,000.00	222,400.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	5,700,000.00	6,870,780.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	429,085.24	
NETHERLANDS GOVERNMENT	100,000.00	102,275.50	

NETHERLANDS GOVERNMENT	8,700,000.00	9,631,596.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	1,565,982.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,900,000.00	2,021,695.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,500,000.00	2,723,885.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	12,300,000.00	17,907,570.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	1,096,800.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	3,400,000.00	3,602,600.90	
NETHERLANDS GOVERNMENT	9,500,000.00	12,830,700.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,200,000.00	3,727,444.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT	500,000.00	556,476.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	2,748,760.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT	7,500,000.00	13,052,490.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	800,000.00	1,624,456.80	
REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	733,310.90	
REPUBLIC OF AUSTRIA	3,200,000.00	3,440,960.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	100,000.00	101,371.30	
REPUBLIC OF AUSTRIA	200,000.00	219,030.54	
REPUBLIC OF AUSTRIA	900,000.00	916,335.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	150,000.00	161,698.05	
REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,330,225.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	768,193.30	
REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,421,206.80	
REPUBLIC OF AUSTRIA	5,400,000.00	7,072,920.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	2,157,524.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	7,600,000.00	11,201,793.52	
REPUBLIC OF AUSTRIA	7,600,000.00	8,149,480.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	4,800,000.00	6,455,577.60	
REPUBLIC OF AUSTRIA	400,000.00	676,304.80	
REPUBLIC OF AUSTRIA	3,200,000.00	5,479,972.80	
REPUBLIC OF AUSTRIA	7,100,000.00	9,450,810.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	2,280,428.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	450,000.00	1,049,265.90	
REPUBLIC OF IRELAND	4,450,000.00	4,984,649.70	
SPANISH GOVERNMENT	16,000,000.00	23,818,008.00	
SPANISH GOVERNMENT	31,800,000.00	51,388,800.00	

小計	SPANISH GOVERNMENT	500,000.00	769,185.00
	銘柄数：253	1,482,400,000.00	1,926,786,381.18 (235,337,688,597)
	組入時価比率：40.1%		40.4%
英債券	UK TREASURY	470,000.00	490,393.30
	UK TREASURY	650,000.00	693,777.50
	UK TREASURY	400,000.00	415,960.00
	UK TREASURY	6,000,000.00	6,031,380.00
	UK TREASURY	14,000,000.00	14,365,260.00
	UK TREASURY	1,100,000.00	1,181,092.00
	UK TREASURY	1,600,000.00	1,667,664.00
	UK TREASURY	7,450,000.00	8,335,581.50
	UK TREASURY	9,950,000.00	12,303,274.50
	UK TREASURY	200,000.00	206,970.00
	UK TREASURY	200,000.00	221,902.00
	UK TREASURY	160,000.00	175,148.80
	UK TREASURY	400,000.00	435,600.00
	UK TREASURY	9,630,000.00	12,667,976.10
	UK TREASURY	200,000.00	226,528.00
	UK TREASURY	7,900,000.00	11,819,901.00
	UK TREASURY	6,000,000.00	8,860,200.00
	UK TREASURY	5,550,000.00	8,149,620.00
	UK TREASURY	15,700,000.00	24,658,420.00
	UK TREASURY	2,600,000.00	4,098,640.00
	UK TREASURY	100,000.00	174,410.00
	UK TREASURY	600,000.00	1,002,900.00
	UK TREASURY	500,000.00	850,600.00
	UK TREASURY	400,000.00	449,880.00
	UK TREASURY	920,000.00	1,665,108.00
	UK TREASURY	18,440,000.00	30,300,608.00
	UK TREASURY	6,300,000.00	11,775,960.00
UK TREASURY	8,200,000.00	9,907,240.00	
UK TREASURY	16,100,000.00	20,674,010.00	
UK TREASURY	5,350,000.00	10,481,185.00	
UK TREASURY	6,750,000.00	12,810,150.00	

小計	UK TREASURY	1,000,000.00	1,298,400.00	
	UK TREASURY	700,000.00	958,790.00	
	UK TREASURY	100,000.00	174,200.00	
	UK TREASURY	650,000.00	1,435,395.00	
	UK TSY 3 1/4% 2044	27,900,000.00	43,655,130.00	
	UNITED KINGDOM(GOVERNMENT	6,800,000.00	14,557,440.00	
	銘柄数：37	190,970,000.00	279,176,694.70	(37,633,018,445)
組入時価比率：6.4%			6.5%	
スウェーデンク ローナ	SWEDISH GOVERNMENT	36,050,000.00	38,613,155.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	7,900,000.00	8,386,245.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	32,250,000.00	36,624,712.50	
	SWEDISH GOVERNMENT	12,000,000.00	12,958,120.80	
	SWEDISH GOVERNMENT	16,800,000.00	18,028,795.68	
	SWEDISH GOVERNMENT	14,300,000.00	15,425,982.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	10,500,000.00	16,464,133.35	
小計	銘柄数：7	129,800,000.00	146,501,144.33	(1,731,643,525)
組入時価比率：0.3%			0.3%	
ノルウェークロー ネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	10,300,000.00	10,831,995.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	38,900,000.00	42,826,955.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	5,011,140.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,991,400.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	9,600,000.00	10,399,680.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	7,200,000.00	8,007,840.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	22,000,000.00	24,248,400.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	2,700,000.00	2,894,373.00	
小計	銘柄数：8	100,100,000.00	109,211,783.00	(1,260,303,975)
組入時価比率：0.2%			0.2%	
デンマーククロー ネ	KINGDOM OF DENMARK	14,400,000.00	15,087,657.60	
	KINGDOM OF DENMARK	400,000.00	407,920.00	
	KINGDOM OF DENMARK	22,770,000.00	24,375,285.00	
	KINGDOM OF DENMARK	32,000,000.00	35,923,200.00	
	KINGDOM OF DENMARK	15,700,000.00	16,811,560.00	
	KINGDOM OF DENMARK	21,400,000.00	23,122,700.00	

小計	KINGDOM OF DENMARK	38,100,000.00	72,130,889.52
	銘柄数：7	144,770,000.00	187,859,212.12 (3,080,891,078)
	組入時価比率：0.5%		0.5%
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	51,600,000.00	53,599,546.44
	POLAND GOVERNMENT BOND	34,800,000.00	37,561,223.40
	POLAND GOVERNMENT BOND	22,000,000.00	24,499,200.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	15,000,000.00	16,951,507.50
小計	銘柄数：4	123,400,000.00	132,611,477.34 (3,612,336,642)
	組入時価比率：0.6%		0.6%
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	9,800,000.00	10,042,645.06
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,040,000.00	3,369,140.80
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	80,000.00	83,688.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,400,000.00	6,174,462.06
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,200,000.00	7,848,360.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	15,200,000.00	17,230,867.44
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,780,000.00	15,493,637.46
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,100,000.00	15,421,541.96
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,200,000.00	3,677,303.36
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	17,800,000.00	19,854,120.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,100,000.00	2,435,305.74
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,100,000.00	12,186,178.23
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	13,300,000.00	15,578,290.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	11,500,000.00	13,250,850.85
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,400,000.00	2,415,952.56
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,700,000.00	10,896,884.46
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	2,173,082.40
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4,000,000.00	5,414,293.20
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	700,000.00	893,130.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,549,082.47
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,300,000.00	6,597,970.00
小計	銘柄数：21	146,800,000.00	172,586,786.05 (12,925,024,407)
	組入時価比率：2.2%		2.2%
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	2,400,000.00	2,428,320.00

	SINGAPORE GOVERNMENT	400,000.00	410,408.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,400,000.00	2,546,160.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	311,160.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,600,000.00	3,859,200.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,450,000.00	1,534,100.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,900,000.00	2,101,780.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,100,000.00	1,199,192.50	
	SINGAPORE GOVERNMENT	700,000.00	762,650.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,900,000.00	4,612,530.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	570,000.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	351,649.50	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,400,000.00	2,856,000.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,200,000.00	1,545,600.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,100,000.00	2,440,011.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,050,000.00	2,654,750.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,000,000.00	1,338,000.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,000,000.00	1,169,930.00	
小計	銘柄数：18	28,700,000.00	32,691,441.00	
			(2,520,183,186)	
	組入時価比率：0.4%		0.4%	
リンギ	MALAYSIA GOVERNMENT	1,100,000.00	1,134,505.24	
	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	429,636.32	
	MALAYSIA GOVERNMENT	2,600,000.00	3,024,857.68	
	MALAYSIA GOVERNMENT	3,800,000.00	4,109,392.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	472,467.68	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	400,000.00	409,148.04	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	6,200,000.00	6,363,400.38	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	500,000.00	511,989.05	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,738,288.88	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	500,000.00	519,731.80	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	13,500,000.00	14,017,229.55	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,500,000.00	3,660,871.20	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,314,208.60	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,800,000.00	6,250,319.54	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	600,000.00	652,031.40	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	9,600,000.00	10,663,850.88	

	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	5,016,408.56	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	7,000,000.00	7,481,273.10	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,373,756.22	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,700,000.00	3,213,497.61	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	280,000.00	307,856.27	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	12,700,000.00	14,573,027.75	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,400,000.00	4,955,033.60	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	400,000.00	443,472.72	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	800,000.00	860,467.12	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	900,000.00	1,012,325.04	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,800,000.00	3,360,847.28	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	9,700,000.00	11,576,392.25	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,100,000.00	4,717,878.20	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	300,000.00	359,928.84	
小計	銘柄数：30	108,580,000.00	119,524,093.00	
			(3,004,835,698)	
	組入時価比率：0.5%		0.5%	
新シェケル	ISRAEL FIXED BOND	2,600,000.00	2,818,880.74	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,067,336.00	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,135,945.00	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,559,623.50	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,222,534.00	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,655,520.50	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,374,808.00	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	6,836,897.50	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,577,411.00	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,693,500.00	
	ISRAEL FIXED BOND	2,000,000.00	2,071,082.20	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	8,913,424.50	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	7,384,520.50	
小計	銘柄数：13	59,600,000.00	71,311,483.44	
			(2,218,500,249)	
	組入時価比率：0.4%		0.4%	
合計			582,163,360,083	
			(582,163,360,083)	

(注1)外貨建有価証券については、通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(注3)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

(3)貸付有価証券の明細(2020年 7月17日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B	24,000,000	
		US TREASURY N/B	1,700,000	
		US TREASURY N/B	10,000,000	
		US TREASURY N/B	30,000,000	
		US TREASURY N/B	1,500,000	
		US TREASURY N/B	10,227,000	
		US TREASURY N/B	6,400,000	
		US TREASURY N/B	5,000,000	
		US TREASURY N/B	8,925,000	
		US TREASURY N/B	18,000,000	
		US TREASURY N/B	31,000,000	
		US TREASURY N/B	10,000,000	
		US TREASURY BOND	23,000,000	
		US TREASURY BOND	41,000,000	
		US TREASURY N/B	28,000,000	
		US TREASURY BOND	36,000,000	
		US TREASURY BOND	50,000,000	
		US TREASURY BOND	9,403,000	
		US TREASURY BOND	1,000,000	
		US TREASURY BOND	32,000,000	
		US TREASURY BOND	25,000,000	
		US TREASURY N/B	3,655,000	
		US TREASURY N/B	29,000,000	
		US TREASURY N/B	9,265,000	
		US TREASURY N/B	9,600,000	
		US TREASURY N/B	8,400,000	
		US TREASURY N/B	1,700,000	
		US TREASURY N/B	1,530,000	
		US TREASURY N/B	12,500,000	
		US TREASURY N/B	8,000,000	
		US TREASURY N/B	7,000,000	
		US TREASURY N/B	25,000,000	
		US TREASURY N/B	10,030,000	
		US TREASURY N/B	29,000,000	
		US TREASURY N/B	17,000,000	
		US TREASURY N/B	85,000	
		US TREASURY N/B	40,000,000	
		US TREASURY N/B	765,000	
		US TREASURY N/B	16,000,000	
		US TREASURY N/B	5,000,000	
		US TREASURY N/B	425,000	
		US TREASURY N/B	22,000,000	

	US TREASURY N/B	20,600,000	
	US TREASURY N/B	2,000,000	
	US TREASURY N/B	85,000	
	US TREASURY N/B	25,000,000	
	US TREASURY N/B	21,000,000	
	US TREASURY N/B	5,000,000	
	US TREASURY N/B	20,000,000	
	US TREASURY N/B	36,000,000	
	US TREASURY N/B	8,670,000	
	US TREASURY N/B	7,140,000	
	US TREASURY N/B	6,826,000	
	US TREASURY N/B	19,700,000	
	US TREASURY N/B	9,755,000	
	US TREASURY N/B	33,000,000	
	US TREASURY N/B	1,000,000	
	US TREASURY N/B	35,000,000	
	US TREASURY BOND	38,000,000	
	US TREASURY BOND	335,000	
	US TREASURY N/B	30,000,000	
	US TREASURY N/B	2,000,000	
	US TREASURY N/B	4,925,000	
	US TREASURY N/B	41,000,000	
	US TREASURY N/B	27,000,000	
	US TREASURY N/B	1,105,000	
	US TREASURY N/B	12,000,000	
	US TREASURY N/B	155,000	
	US TREASURY N/B	26,000,000	
	US TREASURY N/B	36,000,000	
	US TREASURY N/B	34,000,000	
	US TREASURY N/B	1,530,000	
	US TREASURY N/B	25,000,000	
	US TREASURY N/B	15,626,000	
	US TREASURY N/B	1,020,000	
ユーロ	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,100,000	

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2020年 7月17日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	536,351,672	-	536,942,000	590,328
米ドル	224,773,547	-	225,267,000	493,453
ユーロ	244,167,800	-	244,280,000	112,200
英ポンド	67,410,325	-	67,395,000	15,325

合計	536,351,672	-	536,942,000	590,328
----	-------------	---	-------------	---------

(注) 時価の算定方法

1 為替予約取引

1) 計算日において対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。

計算日において為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・ 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2) 計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算日の対顧客相場の仲値で評価しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

新興国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2020年 7月17日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	142,942,774
コール・ローン	163,020,614
国債証券	20,874,362,555
派生商品評価勘定	270,486
未収利息	248,388,696
前払費用	8,461,286
流動資産合計	21,437,446,411
資産合計	21,437,446,411
負債の部	
流動負債	
未払金	179,978,077
未払解約金	5,762,074
未払利息	189
その他未払費用	142,500
流動負債合計	185,882,840
負債合計	185,882,840
純資産の部	
元本等	
元本	10,757,567,126
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	10,493,996,445
元本等合計	21,251,563,571
純資産合計	21,251,563,571
負債純資産合計	21,437,446,411

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 費用・収益の計上基準	<p>有価証券売買等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。</p>

（貸借対照表に関する注記）

2020年 7月17日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.9755円
(10,000口当たり純資産額)	(19,755円)

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2020年 1月18日 至 2020年 7月17日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p>

委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。

市場リスクの管理

市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。

信用リスクの管理

信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。

流動性リスクの管理

流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。

(2)金融商品の時価等に関する事項

2020年 7月17日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
国債証券	
(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	
派生商品評価勘定	
デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており	
ます。	

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

2020年 7月17日現在	
期首	2020年 1月18日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	11,225,831,510円
同期中における追加設定元本額	2,688,148,941円
同期中における一部解約元本額	3,156,413,325円
期末元本額	10,757,567,126円
期末元本額の内訳*	
野村インデックスファンド・新興国債券・為替ヘッジ型	689,810,066円
ネクストコア	21,737,982円
野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型	807,902,962円
インデックス・ブレンド(タイプ)	3,105,664円
インデックス・ブレンド(タイプ)	3,100,867円
インデックス・ブレンド(タイプ)	11,046,324円
インデックス・ブレンド(タイプ)	3,224,879円
インデックス・ブレンド(タイプ)	6,717,201円
野村外国債券(含む新興国)インデックス Aコース(野村投資一任口座向け)	986,741,733円
野村外国債券(含む新興国)インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)	1,769,491,097円
NEXT FUNDS 新興国債券・J.P.モルガン・エマージング・マーケット	
・ボンド・インデックス・プラス(為替ヘッジなし)連動型上場投信	249,210,805円

ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国債券	435,996,191円
野村世界インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	6,677,071円
ノムラ新興国債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	3,443,896円
新興国債券・インデックスF(適格機関投資家専用)	644,316,595円
オールウェザー・ファクターアロケーションMオープン投信(適格機関投資家専用)	322,400,782円
野村新興国債券インデックスファンド(確定拠出年金向け)	4,442,095,168円
野村DC運用戦略ファンド	316,775,926円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	33,771,917円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2020年7月17日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2020年7月17日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	ARGENT-GLOBAL	640,000.00	447,777.28	
		ARGENT-GLOBAL	420,000.00	290,641.59	
		ARGENT-GLOBAL	2,300,000.00	950,003.50	
		BRAZIL GLOBAL	650,000.00	801,944.00	
		BRAZIL GLOBAL	670,000.00	882,524.00	
		BRAZIL GLOBAL	900,000.00	1,096,249.50	
		COLOMBIA GLOBAL	250,000.00	303,036.25	
		COLOMBIA GLOBAL	1,220,000.00	1,711,050.00	
		CROATIA	1,100,000.00	1,218,404.00	
		CROATIA	1,000,000.00	1,151,570.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,300,000.00	1,332,500.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	2,300,000.00	2,450,822.50	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	900,000.00	1,033,987.50	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,200,000.00	1,278,234.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,900,000.00	1,984,673.50	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,500,000.00	1,585,500.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,600,000.00	1,574,872.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	2,600,000.00	2,750,267.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	500,000.00	478,317.50	
		HUNGARY	1,100,000.00	1,213,285.70	
		HUNGARY	1,050,000.00	1,200,553.20	
		HUNGARY	1,600,000.00	1,827,440.00	
		INDONESIA GLOBAL	1,400,000.00	1,593,063.50	
MEXICO GLOBAL	1,080,000.00	1,445,655.60			

PANAMA GLOBAL	500,000.00	635,535.00	
PANAMA GLOBAL	250,000.00	385,267.50	
PANAMA GLOBAL	1,350,000.00	1,990,311.75	
PERU GLOBAL	900,000.00	1,153,039.50	
PERU GLOBAL	670,000.00	1,041,384.35	
PHILIPPINES GLOBAL	1,400,000.00	1,529,691.66	
PHILIPPINES GLOBAL	1,250,000.00	2,047,201.62	
PHILIPPINES GLOBAL	800,000.00	1,206,572.24	
PHILIPPINES GLOBAL	500,000.00	698,996.30	
REPUBLIC OF ARGENTINA	900,000.00	367,285.50	
REPUBLIC OF ARGENTINA	2,650,000.00	1,145,634.75	
REPUBLIC OF ARGENTINA	600,000.00	259,803.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	4,100,000.00	1,735,120.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	2,300,000.00	948,750.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	2,300,000.00	948,428.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	1,500,000.00	614,790.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	2,100,000.00	860,590.50	
REPUBLIC OF ARGENTINA	2,150,000.00	882,779.25	
REPUBLIC OF ARGENTINA	1,300,000.00	526,565.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	200,000.00	204,731.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	2,100,000.00	2,228,803.50	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,000,000.00	1,102,355.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	800,000.00	857,856.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,400,000.00	1,556,198.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,320,000.00	1,696,200.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,500,000.00	1,862,692.50	
REPUBLIC OF COLOMBIA	2,200,000.00	2,577,949.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,200,000.00	1,455,198.00	
REPUBLIC OF HUNGARY	600,000.00	1,020,144.00	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,000,000.00	1,045,983.10	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,300,000.00	1,421,046.51	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,300,000.00	1,475,525.22	
REPUBLIC OF INDONESIA	700,000.00	782,581.17	
REPUBLIC OF INDONESIA	400,000.00	436,202.76	
REPUBLIC OF INDONESIA	800,000.00	855,257.60	
REPUBLIC OF INDONESIA	300,000.00	333,931.68	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,100,000.00	1,282,269.23	
REPUBLIC OF INDONESIA	400,000.00	426,420.40	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,150,000.00	1,753,037.57	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,200,000.00	1,510,584.96	
REPUBLIC OF INDONESIA	800,000.00	936,795.20	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,000,000.00	1,484,233.60	
	800,000.00	1,006,580.24	

REPUBLIC OF INDONESIA			
REPUBLIC OF INDONESIA	1,000,000.00	1,391,590.80	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,400,000.00	1,790,928.30	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,500,000.00	1,724,065.50	
REPUBLIC OF INDONESIA	400,000.00	524,716.24	
REPUBLIC OF PANAMA	700,000.00	764,683.50	
REPUBLIC OF PANAMA	1,700,000.00	1,933,503.50	
REPUBLIC OF PANAMA	400,000.00	436,750.00	
REPUBLIC OF PANAMA	800,000.00	1,004,444.00	
REPUBLIC OF PANAMA	800,000.00	1,010,008.00	
REPUBLIC OF PERU	300,000.00	348,321.00	
REPUBLIC OF PERU	500,000.00	544,280.00	
REPUBLIC OF PERU	1,500,000.00	2,421,442.50	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	500,000.00	550,248.65	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	800,000.00	969,083.28	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,900,000.00	2,189,814.60	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	800,000.00	1,160,896.96	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	800,000.00	1,040,064.64	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,100,000.00	1,295,191.15	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	2,000,000.00	2,322,576.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	750,000.00	792,562.50	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,350,000.00	1,435,725.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	800,000.00	803,295.20	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,200,000.00	1,111,884.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	800,000.00	762,216.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	700,000.00	716,250.50	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	700,000.00	617,330.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	500,000.00	471,828.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,800,000.00	1,585,116.00	
REPUBLIC OF TURKEY	600,000.00	603,132.00	
REPUBLIC OF TURKEY	1,700,000.00	1,733,490.00	
REPUBLIC OF TURKEY	300,000.00	285,492.00	
REPUBLIC OF TURKEY	900,000.00	937,476.00	
REPUBLIC OF TURKEY	600,000.00	606,841.20	
REPUBLIC OF TURKEY	400,000.00	363,324.00	
REPUBLIC OF TURKEY	1,300,000.00	1,199,097.90	
REPUBLIC OF TURKEY	2,300,000.00	2,236,290.00	
REPUBLIC OF TURKEY	900,000.00	824,441.40	
REPUBLIC OF TURKEY	1,100,000.00	1,061,500.00	
REPUBLIC OF TURKEY	2,800,000.00	2,927,400.00	
REPUBLIC OF TURKEY	950,000.00	884,440.50	
REPUBLIC OF TURKEY	1,200,000.00	1,028,232.00	
REPUBLIC OF TURKEY	2,400,000.00	1,826,016.00	

REPUBLIC OF TURKEY	2,100,000.00	1,882,941.90
REPUBLIC OF TURKEY	1,900,000.00	1,525,962.20
ROMANIA	600,000.00	647,631.60
ROMANIA	800,000.00	854,400.00
ROMANIA	400,000.00	438,824.00
ROMANIA	800,000.00	1,048,956.80
ROMANIA	600,000.00	710,988.00
RUSSIA	1,032,500.00	1,192,005.76
RUSSIAN FEDERATION	1,000,000.00	1,059,290.00
RUSSIAN FEDERATION	2,000,000.00	2,224,830.00
RUSSIAN FEDERATION	1,400,000.00	1,611,316.00
RUSSIAN FEDERATION	1,600,000.00	1,798,192.00
RUSSIAN FEDERATION	1,800,000.00	2,065,536.00
RUSSIAN FEDERATION	2,200,000.00	2,746,576.80
RUSSIAN FEDERATION	1,600,000.00	2,206,256.00
RUSSIAN FEDERATION	1,000,000.00	1,430,766.00
RUSSIAN FEDERATION	4,000,000.00	5,433,992.00
TURKEY GLOBAL	1,500,000.00	1,489,203.00
TURKEY GLOBAL	2,400,000.00	2,521,948.80
TURKEY GLOBAL	850,000.00	1,145,464.25
UKRAINE GOVERNMENT	600,000.00	622,101.00
UKRAINE GOVERNMENT	1,500,000.00	1,697,205.00
UKRAINE GOVERNMENT	1,400,000.00	1,394,610.00
UKRAINE GOVERNMENT REGS	609,000.00	626,278.54
UKRAINE GOVERNMENT REGS	709,000.00	734,346.75
UKRAINE GOVERNMENT REGS	700,000.00	735,627.20
UKRAINE GOVERNMENT REGS	1,200,000.00	1,249,611.60
UKRAINE GOVERNMENT REGS	1,200,000.00	1,231,800.00
UNITED MEXICAN STATES	1,300,000.00	1,485,633.50
UNITED MEXICAN STATES	1,100,000.00	1,151,150.00
UNITED MEXICAN STATES	1,950,000.00	2,097,410.25
UNITED MEXICAN STATES	1,200,000.00	1,285,080.00
UNITED MEXICAN STATES	1,300,000.00	1,423,396.00
UNITED MEXICAN STATES	1,600,000.00	1,741,400.00
UNITED MEXICAN STATES	700,000.00	740,918.50
UNITED MEXICAN STATES	2,000,000.00	2,213,750.00
UNITED MEXICAN STATES	2,110,000.00	2,646,583.55
UNITED MEXICAN STATES	1,500,000.00	1,632,457.50
UNITED MEXICAN STATES	1,700,000.00	2,063,392.00
UNITED MEXICAN STATES	1,700,000.00	1,807,193.50
UNITED MEXICAN STATES	1,400,000.00	1,441,713.00
UNITED MEXICAN STATES	1,700,000.00	1,805,901.50

		UNITED MEXICAN STATES	1,500,000.00	1,587,000.00	
	小計	銘柄数：152	186,480,500.00	194,578,323.60	
				(20,874,362,555)	
		組入時価比率：98.2%		100.0%	
	合計			20,874,362,555	
				(20,874,362,555)	

(注1)外貨建有価証券については、通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(注3)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2020年 7月17日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
	うち1年超			
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	148,834,814	-	149,105,300	270,486
米ドル	148,834,814	-	149,105,300	270,486
合計	148,834,814	-	149,105,300	270,486

(注)時価の算定方法

1 為替予約取引

1)計算日において対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。

計算日において為替予約の受渡日(以下「当該日」といいます)の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2)計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算日の対顧客相場の仲値で評価しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

2 ファンドの現況

純資産額計算書

野村外国債券(含む新興国)インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)

2020年8月31日現在

資産総額	21,031,830,355円
負債総額	39,768,927円
純資産総額(-)	20,992,061,428円
発行済口数	21,400,663,115口
1口当たり純資産額(/)	0.9809円

（参考）外国債券マザーファンド

2020年8月31日現在

資産総額	594,925,729,963円
負債総額	5,472,599,953円
純資産総額（ - ）	589,453,130,010円
発行済口数	239,484,606,179口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4613円

（参考）新興国債券マザーファンド

2020年8月31日現在

資産総額	21,109,578,151円
負債総額	181,924,642円
純資産総額（ - ）	20,927,653,509円
発行済口数	10,540,488,065口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9855円

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1 委託会社等の概況

< 更新後 >

(1) 資本金の額

2020年8月末現在、17,180百万円

会社が発行する株式総数 20,000,000株

発行済株式総数 5,150,693株

過去5年間における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構

(a) 会社の意思決定機構

当社は監査等委員会設置会社であり、会社の機関として株主総会、取締役会のほか代表取締役および監査等委員会を設けております。各機関の権限は以下のとおりです。

株主総会

株主により構成され、取締役・会計監査人の選任・解任、剰余金の配当の承認、定款変更・合併等の重要事項の承認等を行います。

取締役会

取締役により構成され、当社の業務につき意思決定を行います。また代表取締役等を選任し、取締役の職務の執行を監督します。

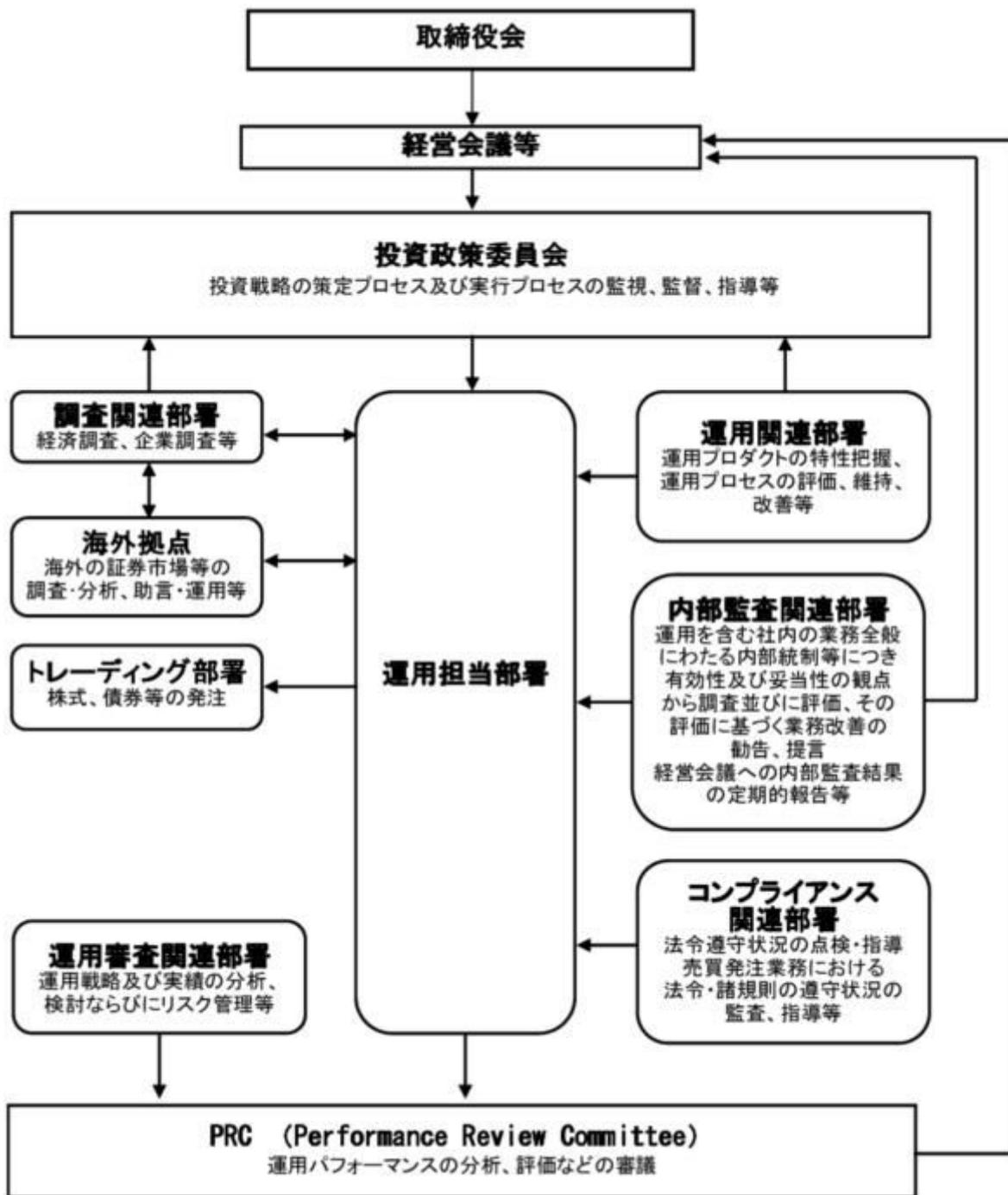
代表取締役・業務執行取締役

代表取締役を含む各業務執行取締役は、当社の業務の執行を行います。代表取締役は当社を代表いたします。また取締役会により委任された一定の事項について、代表取締役を含む業務執行取締役で構成される経営会議が意思決定を行います。なお、当社は執行役員制度を導入しており、経営会議の構成員には執行役員が含まれます。

監査等委員会

監査等委員である取締役3名以上（但し、過半数は社外取締役）で構成され、取締役の職務執行の適法性および妥当性に関する監査を行うとともに、株主総会に提出する会計監査人の選任・解任・不再任に関する議案の内容や監査等委員である取締役以外の取締役の選任・解任・辞任および報酬等についての監査等委員会としての意見を決定します。

(b)投資信託の運用体制



2 事業の内容及び営業の概況

<更新後>

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託者は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業に係る業務の一部及び投資助言業務を行っています。

委託者の運用する証券投資信託は2020年7月31日現在次の通りです(ただし、親投資信託を除きます。)

種類	本数	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	995	29,361,957
単位型株式投資信託	185	838,713
追加型公社債投資信託	14	5,664,415
単位型公社債投資信託	461	1,604,845
合計	1,655	37,469,931

3 委託会社等の経理状況

<更新後>

1. 委託会社である野村アセットマネジメント株式会社(以下「委託会社」という)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という)、ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。
2. 財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度(2019年4月1日から2020年3月31日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

(1) 貸借対照表

区分	注記 番号	前事業年度 (2019年3月31日)		当事業年度 (2020年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
(資産の部)					
流動資産					
現金・預金			1,562		2,626
金銭の信託			45,493		41,524
有価証券			19,900		24,399
前払費用			27		106
未収入金			500		522
未収委託者報酬			25,246		23,936
未収運用受託報酬			5,933		4,336
その他			269		71
貸倒引当金			15		14
流動資産計			98,917		97,509
固定資産					
有形固定資産					
建物	2	320		295	
器具備品	2	393		349	

無形固定資産		6,438		5,894
ソフトウェア	6,437		5,893	
その他	0		0	
投資その他の資産		18,608		16,486
投資有価証券	1,562		1,437	
関係会社株式	12,631		10,171	
従業員長期貸付金	-		16	
長期差入保証金	235		329	
長期前払費用	22		19	
前払年金費用	2,001		1,545	
繰延税金資産	2,694		2,738	
その他	168		229	
貸倒引当金	-		0	
投資損失引当金	707		-	
固定資産計		25,761		23,026
資産合計		124,679		120,536

区分	注記 番号	前事業年度 (2019年3月31日)		当事業年度 (2020年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
(負債の部)					
流動負債					
預り金			145		157
未払金			16,709		15,279
未払収益分配金		0		0	
未払償還金		25		3	
未払手数料		7,724		6,948	
関係会社未払金		7,422		7,262	
その他未払金		1,535		1,063	
未払費用	1		11,704		10,290
未払法人税等			1,560		1,564
前受収益			29		26
賞与引当金			3,792		3,985
その他			-		67
流動負債計			33,942		31,371
固定負債					
退職給付引当金			3,219		3,311
時効後支払損引当金			558		572
固定負債計			3,777		3,883
負債合計			37,720		35,254
(純資産の部)					
株主資本					
資本金			86,924		85,270
資本剰余金			17,180		17,180
資本剰余金			13,729		13,729
資本準備金		11,729		11,729	
その他資本剰余金		2,000		2,000	
利益剰余金			56,014		54,360
利益剰余金			685		685
その他利益剰余金		55,329		53,675	
別途積立金		24,606		24,606	

繰越利益剰余金		30,723		29,069	
評価・換算差額等			33		10
その他有価証券評価差額金			33		10
純資産合計			86,958		85,281
負債・純資産合計			124,679		120,536

(2) 損益計算書

区分	注記 番号	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
営業収益					
委託者報酬			119,196		115,736
運用受託報酬			21,440		17,170
その他営業収益			355		340
営業収益計			140,992		133,247
営業費用					
支払手数料			42,675		39,435
広告宣伝費			1,210		1,006
公告費			0		-
調査費			30,082		26,833
調査費		5,998		5,696	
委託調査費		24,083		21,136	
委託計算費			1,311		1,342
営業雑経費			5,435		5,823
通信費		92		75	
印刷費		970		958	
協会費		86		92	
諸経費		4,286		4,696	
営業費用計			80,715		74,440
一般管理費					
給料			11,113		11,418
役員報酬		379		109	
給料・手当		7,067		7,173	
賞与		3,666		4,134	
交際費			107		86
旅費交通費			514		391
租税公課			1,048		1,029
不動産賃借料			1,223		1,227
退職給付費用			1,474		1,486
固定資産減価償却費			2,835		2,348
諸経費			10,115		10,067
一般管理費計			28,433		28,055
営業利益			31,843		30,751

		前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
区分	注記 番号	金額(百万円)		金額(百万円)	
営業外収益					
受取配当金	1	6,538		4,936	
受取利息		0		0	
その他		424		309	
営業外収益計			6,964		5,246
営業外費用					
支払利息	1	1		-	
金銭の信託運用損		489		230	
投資事業組合等評価損		-		146	
時効後支払損引当金繰入額		43		18	
為替差損		34		23	
その他		17		23	
営業外費用計			585		443
経常利益			38,222		35,555
特別利益					
投資有価証券等売却益		20		21	
関係会社清算益	3	29		-	
株式報酬受入益		85		59	
特別利益計			135		81
特別損失					
投資有価証券等評価損		938		119	
関係会社株式評価損		161		1,591	
固定資産除却損	2	310		67	
投資損失引当金繰入額		707		-	
特別損失計			2,118		1,778
税引前当期純利益			36,239		33,858
法人税、住民税及び事業税			10,196		9,896
法人税等調整額			370		34
当期純利益			25,672		23,996

(3) 株主資本等変動計算書

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位:百万円)

	株主資本								株主 資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益 準備金	利益剰余金		利益 剰余金 合計	
		資本 準備金	その他 資本 剰余金	資本 剰余金 合計		その他利益剰余金			
						別途 積立金	繰 越 利益 剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,876	55,168	86,078

当期変動額									
剰余金の配当							24,826	24,826	24,826
当期純利益							25,672	25,672	25,672
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	846	846	846
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,723	56,014	86,924

(単位：百万円)

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	11	11	86,090
当期変動額			
剰余金の配当			24,826
当期純利益			25,672
株主資本以外の項目 の当期変動額(純 額)	21	21	21
当期変動額合計	21	21	868
当期末残高	33	33	86,958

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本								株主 資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益 準備金	利益剰余金		利益 剰余金 合計	
		資本 準備金	その他 資本 剰余金	資本 剰余金 合計		別途 積立金	繰 越 利益 剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,723	56,014	86,924
当期変動額									
剰余金の配当							25,650	25,650	25,650
当期純利益							23,996	23,996	23,996
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純 額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,653	1,653	1,653

当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,069	54,360	85,270
-------	--------	--------	-------	--------	-----	--------	--------	--------	--------

(単位：百万円)

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	33	33	86,958
当期変動額			
剰余金の配当			25,650
当期純利益			23,996
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)	23	23	23
当期変動額合計	23	23	1,676
当期末残高	10	10	85,281

[重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ... 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの ... 決算期末日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定しております。) 時価のないもの ... 移動平均法による原価法</p>								
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法								
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、1998年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)、並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。 主な耐用年数は以下の通りであります。 <table style="margin-left: 20px;"> <tr> <td>建物</td> <td>38～50年</td> </tr> <tr> <td>附属設備</td> <td>8～15年</td> </tr> <tr> <td>構築物</td> <td>20年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>4～15年</td> </tr> </table> </p> <p>(2) 無形固定資産及び投資その他の資産 定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>	建物	38～50年	附属設備	8～15年	構築物	20年	器具備品	4～15年
建物	38～50年								
附属設備	8～15年								
構築物	20年								
器具備品	4～15年								
4. 引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金 一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金 賞与の支払いに備えるため、支払見込額を計上しております。</p>								

<p>5 . 消費税等の会計処理方法</p> <p>6 . 連結納税制度の適用</p>	<p>(3) 退職給付引当金 従業員からの退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企業年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 確定給付型企業年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。 退職一時金及び確定給付型企業年金に係る過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p> <p>消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当期の費用として処理してまいります。</p> <p>連結納税制度を適用しております。 なお、当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。</p>
---	---

[未適用の会計基準等]

- ・ 「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年3月31日）
- ・ 「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 2020年3月31日）

(1) 概要

収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の5つのステップを適用し認識されません。

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

- ・「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 2019年7月4日）
- ・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2019年7月4日）
- ・「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 2019年7月4日）
- ・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 2020年3月31日）

(1) 概要

国際的な会計基準の定めとの比較可能性を向上させるため、「時価の算定に関する会計基準」及び「時価の算定に関する会計基準の適用指針（以下「時価算定会計基準等」という。）が開発され、時価の算定方法に関するガイダンス等が定められました。時価算定会計基準等は次の項目の時価に適用されます。

- ・「金融商品に関する会計基準」における金融商品

また「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」が改訂され、金融商品の時価のレベルごとの内訳等の注記事項が定められました。

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

- ・「会計方針の開示、会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 2020年3月31日）

(1) 概要

関連する会計基準等の定めが明らかでない場合に、採用した会計処理の原則及び手続きの概要を示すことを目的とするものです。

(2) 適用予定日

2021年3月期の年度末より適用予定であります。

- ・「会計上の見積りの開示に関する会計基準（企業会計基準第31号 2020年3月31日）

(1) 概要

当年度の財務諸表に計上した金額が会計上の見積りによるもののうち、翌年度の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目における会計上の見積りの内容について、財務諸表利用者の理解に資する情報を開示することを目的とするものです。

(2) 適用予定日

2021年3月期の年度末より適用予定であります。

[注記事項]

貸借対照表関係

前事業年度末 (2019年3月31日)	当事業年度末 (2020年3月31日)
1. 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれているものは、次のとおりであります。 未払費用 1,434百万円	1. 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれているものは、次のとおりであります。 未払費用 1,296百万円

2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額		2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額	
建物	736百万円	建物	761百万円
器具備品	3,106	器具備品	2,347
合計	3,842	合計	3,109

損益計算書関係

前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金 6,531百万円 支払利息 1	1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金 4,931百万円
2. 固定資産除却損 器具備品 3百万円 ソフトウェア 307 合計 310	2. 固定資産除却損 器具備品 7百万円 ソフトウェア 59 合計 67
3. 関係会社清算益 関係会社清算益は、関係会社の清算にともなう清算配当です。	

株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首株式数	当事業年度増加株式数	当事業年度減少株式数	当事業年度末株式数
普通株式	5,150,693株	-	-	5,150,693株

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2018年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	24,826百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,820円
基準日	2018年3月31日
効力発生日	2018年6月25日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

2019年5月15日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	25,650百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,980円

基準日 2019年3月31日
効力発生日 2019年6月28日

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首株式数	当事業年度増加株式数	当事業年度減少株式数	当事業年度末株式数
普通株式	5,150,693株	-	-	5,150,693株

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2019年5月15日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額 25,650百万円
配当の原資 利益剰余金
1株当たり配当額 4,980円
基準日 2019年3月31日
効力発生日 2019年6月28日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

2020年5月19日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額 23,950百万円
配当の原資 利益剰余金
1株当たり配当額 4,650円
基準日 2020年3月31日
効力発生日 2020年6月30日

金融商品関係

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、自らが運用する投資信託の商品性維持等を目的として、当該投資信託を特定金外信託を通じ保有しております。特定金外信託を通じ行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託にかかる将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、投資信託保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

なお、余資運用に関しては、譲渡性預金等安全性の高い金融資産で運用し、資金調達に関しては、親会社である野村ホールディングス株式会社及びその他の金融機関からの短期借入による方針であります。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

特定金外信託を通じ保有している投資信託につきましては、為替変動リスクや価格変動リスクに晒

されておりますが、その大部分については為替予約、株価指数先物、債券先物などのデリバティブ取引によりヘッジしております。また、株式につきましては、政策投資として、あるいは業務上の関係維持を目的として保有しておりますが、価格変動リスクに晒されております。有価証券及び投資有価証券並びに金銭の信託については財務部が管理しており、定期的に時価や発行体の財務状況を把握し、その内容を経営に報告しております。

デリバティブ取引の実行及び管理については、財務部及び運用調査本部で行っております。デリバティブ取引については、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しているため信用リスクはほとんどないと認識しております。財務部は月に一度デリバティブ取引の内容を含んだ財務報告を経営会議で行っております。

また、営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産から委託者に対して支払われる信託報酬の未払金額であり、信託財産は受託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しております。同じく営業債権である未収運用受託報酬は、投資顧問契約に基づき、運用受託者に対して支払われる報酬の未払金額であります。この未収運用受託報酬は、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、信託財産が信託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクにさらされておりますが、顧客ごとに決済期日および残高を管理することにより、回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

2019年3月31日における貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金・預金	1,562	1,562	-
(2)金銭の信託	45,493	45,493	-
(3)未収委託者報酬	25,246	25,246	-
(4)未収運用受託報酬	5,933	5,933	-
(5)有価証券及び投資有価証券	19,900	19,900	-
その他有価証券	19,900	19,900	-
資産計	98,136	98,136	-
(6)未払金	16,709	16,709	-
未払収益分配金	0	0	-
未払償還金	25	25	-
未払手数料	7,724	7,724	-
関係会社未払金	7,422	7,422	-
その他未払金	1,535	1,535	-
(7)未払費用	11,704	11,704	-
(8)未払法人税等	1,560	1,560	-
負債計	29,974	29,974	-

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(2) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。これらの時価について投資信託については基準価額、デリバティブ取引に関しては、上場デリバティブ取引は取引所の価格、為替予約取引は先物為替相場、店頭デリバティブ取引は取引先金融機関から提示された価格等によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

譲渡性預金は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する注記事項については、「有価証券関係」注記を参照ください。

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

注2：非上場株式等（貸借対照表計上額：投資有価証券1,562百万円、関係会社株式12,631百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。なお、当事業年度において、非上場株式について1,100百万円（投資有価証券938百万円、関係会社株式161百万円）減損処理を行っております。

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
預金	1,562	-	-	-
金銭の信託	45,493	-	-	-
未収委託者報酬	25,246	-	-	-
未収運用受託報酬	5,933	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券	19,900	-	-	-
合計	98,136	-	-	-

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、自社が運用する投資信託の商品性維持等を目的として、当該投資信託を特定金外信託を通じ保有しております。特定金外信託を通じ行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託にかかる将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、投資信託保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

なお、余資運用に関しては、譲渡性預金等安全性の高い金融資産で運用し、資金調達に関しては、親会社である野村ホールディングス株式会社及びその他の金融機関からの短期借入による方針であります。

（2）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

特定金外信託を通じ保有している投資信託につきましては、為替変動リスクや価格変動リスクに晒されておりますが、その大部分については為替予約、株価指数先物、債券先物などのデリバティブ取引によりヘッジしております。また、株式につきましては、政策投資として、あるいは業務上の関係維持を目的として保有しておりますが、価格変動リスクに晒されております。有価証券及び投資有価証券並びに金銭の信託については財務部が管理しており、定期的に時価や発行体の財務状況を把握し、その内容を経営に報告しております。

デリバティブ取引の実行及び管理については、財務部及び運用調査本部で行っております。デリバティブ取引については、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しているため信用リスクはほとんどないと認識しております。財務部は月に一度デリバティブ取引の内容を含んだ財務報告を経営会議で行っております。

また、営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産から委託者に対して支払われる信託報酬の未払金額であり、信託財産は受託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しております。同じく営業債権である未収運用受託報酬は、投資顧問契約に基づき、運用受託者に対して支払われる報酬の未払金額であります。この未収運用受託報酬は、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、信託財産が信託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクにさらされておりますが、顧客ごとに決済期日および残高を管理することにより、回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

2020年3月31日における貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
--	----------	----	----

(1)現金・預金	2,626	2,626	-
(2)金銭の信託	41,524	41,524	-
(3)未収委託者報酬	23,936	23,936	-
(4)未収運用受託報酬	4,336	4,336	-
(5)有価証券及び投資有価証券	24,399	24,399	-
その他有価証券	24,399	24,399	-
資産計	96,823	96,823	-
(6)未払金	15,279	15,279	-
未払収益分配金	0	0	-
未払償還金	3	3	-
未払手数料	6,948	6,948	-
関係会社未払金	7,262	7,262	-
その他未払金	1,063	1,063	-
(7)未払費用	10,290	10,290	-
(8)未払法人税等	1,564	1,564	-
負債計	27,134	27,134	-

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(2) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。これらの時価について投資信託については基準価額、デリバティブ取引に関しては、上場デリバティブ取引は取引所の価格、為替予約取引は先物為替相場、店頭デリバティブ取引は取引先金融機関から提示された価格等によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(5) 有価証券及び投資有価証券

 その他有価証券

譲渡性預金及びコマーシャル・ペーパーは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する注記事項については、「有価証券関係」注記を参照ください。

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっており

ます。

注2：非上場株式等（貸借対照表計上額：投資有価証券1,437百万円、関係会社株式10,171百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。当事業年度において、非上場株式について2,416百万円（投資有価証券117百万円、関係会社株式2,298百万円）減損処理を行っております。なお、関係会社株式に係る評価損は、過年度に計上しておりました関係会社株式に対する投資損失引当金の戻入益707百万円と相殺し、関係会社株式評価損1,591百万円を特別損失に計上しております。

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
預金	2,626	-	-	-
金銭の信託	41,524	-	-	-
未収委託者報酬	23,936	-	-	-
未収運用受託報酬	4,336	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券	24,399	-	-	-
合計	96,823	-	-	-

有価証券関係

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1．売買目的有価証券(2019年3月31日)

該当事項はありません。

2．満期保有目的の債券(2019年3月31日)

該当事項はありません。

3．子会社株式及び関連会社株式(2019年3月31日)

該当事項はありません。

4．その他有価証券(2019年3月31日)

区分	貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 株式	-	-	-
小計	-	-	-

貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
譲渡性預金	19,900	19,900	-
小計	19,900	19,900	-
合計	19,900	19,900	-

5．事業年度中に売却したその他有価証券（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1．売買目的有価証券(2020年3月31日)

該当事項はありません。

2．満期保有目的の債券(2020年3月31日)

該当事項はありません。

3．子会社株式及び関連会社株式(2020年3月31日)

該当事項はありません。

4．その他有価証券(2020年3月31日)

区分	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
株式	-	-	-
小計	-	-	-
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
譲渡性預金	4,400	4,400	-
コマーシャル・ペーパー	19,999	19,999	-
小計	24,399	24,399	-
合計	24,399	24,399	-

5．事業年度中に売却したその他有価証券（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

該当事項はありません。

退職給付関係

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として確定給付型企业年金制度及び退職一時金制度を、また確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を設けております。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

退職給付債務の期首残高	21,398 百万円
勤務費用	951
利息費用	179
数理計算上の差異の発生額	1,672
退職給付の支払額	737
過去勤務費用の発生額	71
その他	15
退職給付債務の期末残高	23,551

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

年金資産の期首残高	17,373 百万円
期待運用収益	434
数理計算上の差異の発生額	241
事業主からの拠出額	483
退職給付の支払額	579
年金資産の期末残高	17,469

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

積立型制度の退職給付債務	20,181 百万円
年金資産	17,469
	2,712
非積立型制度の退職給付債務	3,369
未積立退職給付債務	6,082
未認識数理計算上の差異	5,084
未認識過去勤務費用	220
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,218
退職給付引当金	3,219
前払年金費用	2,001
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,218

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	951 百万円
利息費用	179
期待運用収益	434
数理計算上の差異の費用処理額	598
過去勤務費用の費用処理額	38
確定給付制度に係る退職給付費用	1,255

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

債券	47%
株式	41%
生保一般勘定	12%
その他	0%
合計	100%

長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

確定給付型企業年金制度の割引率	0.7%
退職一時金制度の割引率	0.4%
長期期待運用収益率	2.5%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、197百万円でした。

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として確定給付型企業年金制度及び退職一時金制度を、また確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を設けております。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

退職給付債務の期首残高	23,551 百万円
勤務費用	1,034
利息費用	154
数理計算上の差異の発生額	138
退職給付の支払額	858
その他	17
退職給付債務の期末残高	23,761

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

年金資産の期首残高	17,469 百万円
期待運用収益	436
数理計算上の差異の発生額	393
事業主からの拠出額	566
退職給付の支払額	666
年金資産の期末残高	17,413

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

積立型制度の退職給付債務	20,462 百万円
年金資産	17,413
	3,048
非積立型制度の退職給付債務	3,299
未積立退職給付債務	6,347
未認識数理計算上の差異	4,764
未認識過去勤務費用	185
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,766
退職給付引当金	3,311
前払年金費用	1,545
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,766

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	1,034 百万円
利息費用	154
期待運用収益	436
数理計算上の差異の費用処理額	572
過去勤務費用の費用処理額	35
確定給付制度に係る退職給付費用	1,289

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

債券	57%
株式	24%
生保一般勘定	12%
生保特別勘定	7%
その他	0%
合計	100%

長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

確定給付型企業年金制度の割引率	0.6%
退職一時金制度の割引率	0.5%
長期期待運用収益率	2.5%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、202百万円でした。

税効果会計関係

前事業年度末 (2019年3月31日)	当事業年度末 (2020年3月31日)
1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳
繰延税金資産 百万円	繰延税金資産 百万円
賞与引当金 1,175	賞与引当金 1,235
退職給付引当金 998	退職給付引当金 1,026
関係会社株式評価減 51	関係会社株式評価減 762
投資有価証券評価減 708	投資有価証券評価減 462
未払事業税 288	未払事業税 285
時効後支払損引当金 172	時効後支払損引当金 177
減価償却超過額 171	減価償却超過額 171
ゴルフ会員権評価減 192	ゴルフ会員権評価減 167
関係会社株式売却損 148	関係会社株式売却損 148
未払社会保険料 82	未払社会保険料 97
その他 633	その他 219
繰延税金資産小計 4,625	繰延税金資産小計 4,754
評価性引当額 1,295	評価性引当額 1,532
繰延税金資産合計 3,329	繰延税金資産合計 3,222
繰延税金負債	繰延税金負債
その他有価証券評価差額金 15	その他有価証券評価差額金 4
前払年金費用 620	前払年金費用 478
繰延税金負債合計 635	繰延税金負債合計 483
繰延税金資産の純額 2,694	繰延税金資産の純額 2,738

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳		2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳	
法定実効税率	31.0%	法定実効税率	31.0%
(調整)		(調整)	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.1%	交際費等永久に損金に算入されない項目	0.0%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	5.6%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	4.4%
タックスヘイブン税制	2.6%	タックスヘイブン税制	2.6%
外国税額控除	0.6%	外国税額控除	0.7%
外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	0.3%	外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	0.2%
その他	1.3%	その他	0.4%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.1%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.1%

セグメント情報等

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

当社の製品・サービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、製品・サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

(2) 地域ごとの情報

売上高

本邦の外部顧客からの営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

(3) 主要な顧客ごとの情報

外部顧客からの営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、主要な顧客ごとの営業収益の記載を省略しております。

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

当社の製品・サービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、製品・サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

(2) 地域ごとの情報

売上高

本邦の外部顧客からの営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

(3) 主要な顧客ごとの情報

外部顧客からの営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、主要な顧客ごとの営業収益の記載を省略しております。

関連当事者情報

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 親会社及び法人主要株主等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との 関係	取引の内容	取引 金額 (百万円)	科目	期末 残高 (百万円)
親会社	野村ホールディングス株式会社	東京都中央区	594,492 (百万円)	持株会社	(被所有) 直接 100%	資産の賃貸借 及び購入等 役員の兼任	資金の借入 (*1)	3,000	短期借入金	-
							資金の返済	3,000		
							借入金利息 の支払	1	未払費用	-

(イ) 子会社等
該当はありません。

(ウ) 兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との 関係	取引の内容	取引 金額 (百万円)	科目	期末 残高 (百万円)
親会社の 子会社	野村証券株式会社	東京都中央区	10,000 (百万円)	証券業	-	当社投資信託 の募集の取扱 及び売上の取 扱ならびに投 資信託に係る 事務代行の委 託等 役員の兼任	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払(*2)	34,646	未払手数料	6,410

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

- (注) 1. 上記の金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等
(*1) 資金の借入については、市場金利を勘案して利率を合理的に決定しております。
(*2) 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性等を勘案し総合的に決定しております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

野村ホールディングス㈱（東京証券取引所、名古屋証券取引所、シンガポール証券取引所、
ニューヨーク証券取引所に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 親会社及び法人主要株主等

該当はありません。

(イ) 子会社等

該当はありません。

(ウ) 兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
親会社の子会社	野村証券株式会社	東京都中央区	10,000 (百万円)	証券業	-	当社投資信託の募集の取扱及び売出の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払(*1)	31,378	未払手数料	5,536
							コマーシャル・ペーパーの購入(*2)	20,000	有価証券	19,999
							有価証券受取利息	0	その他営業外収益	0

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

- (注) 1. 上記の金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等
(*1) 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性等を勘案し総合的に決定しております。
(*2) コマーシャル・ペーパーの購入については、市場金利を勘案して利率を合理的に決定しております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

野村ホールディングス㈱（東京証券取引所、名古屋証券取引所、シンガポール証券取引所、

ニューヨーク証券取引所に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

1株当たり情報

前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
1株当たり純資産額	16,882円89銭	1株当たり純資産額	16,557円31銭
1株当たり当期純利益	4,984円30銭	1株当たり当期純利益	4,658円88銭
潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。		潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	
1株当たり当期純利益の算定上の基礎		1株当たり当期純利益の算定上の基礎	
損益計算書上の当期純利益	25,672百万円	損益計算書上の当期純利益	23,996百万円
普通株式に係る当期純利益	25,672百万円	普通株式に係る当期純利益	23,996百万円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。		普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。	
普通株式の期中平均株式数	5,150,693株	普通株式の期中平均株式数	5,150,693株

第2【その他の関係法人の概況】

1 名称、資本金の額及び事業の内容

< 更新後 >

(1) 受託者

(a) 名称	(b) 資本金の額 [*]	(c) 事業の内容
野村信託銀行株式会社	35,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。

* 2020年7月末現在

(2) 販売会社

(a) 名称	(b) 資本金の額 [*]	(c) 事業の内容
野村証券株式会社	10,000百万円	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
野村信託銀行株式会社	35,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

* 2020年7月末現在

独立監査人の監査報告書

2020年9月11日

野村アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 亀井純子
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 伊藤志保
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている野村外国債券（含む新興国）インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）の2020年1月18日から2020年7月17日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、野村外国債券（含む新興国）インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）の2020年7月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、野村アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
 - ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
 - ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
 - ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
 - ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。
- 監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

野村アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

-
- (注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

2020年6月10日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 亀井 純子指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 櫻井 雄一郎指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 津村 健二郎

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている野村アセットマネジメント株式会社の2019年4月1日から2020年3月31日までの第61期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、野村アセットマネジメント株式会社の2020年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成すること

が適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査等委員会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

-
- (注) 1．上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
- 2．XBRLデータは監査の対象には含まれていません。